

# 博道成长智航股票型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	68
8.1 期末基金资产组合情况	68
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	69
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	69
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	92
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	107
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	107
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	108
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	108
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	108
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	108

8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	108
8.12	投资组合报告附注	108
§9	基金份额持有人信息	109
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	109
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	110
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	110
§10	开放式基金份额变动	110
§11	重大事件揭示	111
11.1	基金份额持有人大会决议	111
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	111
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	111
11.4	基金投资策略的改变	111
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	111
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	111
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	112
11.8	其他重大事件	113
§12	备查文件目录	116
12.1	备查文件目录	116
12.2	存放地点	117
12.3	查阅方式	117

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博道成长智航股票型证券投资基金	
基金简称	博道成长智航股票	
基金主代码	013641	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年10月26日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,895,685,108.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C
下属分级基金的交易代码	013641	013642
报告期末下属分级基金的份额总额	1,429,086,140.62份	2,466,598,967.75份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注成长风格相关上市公司股票的投资机会，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金，重点关注成长风格相关上市公司股票的投资机会，选取中信成长风格指数为业绩比较基准中股票资产部分的基准指数，通过量化选股模型构建股票组合，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。首先，综合考虑股票的盈利情况、风险情况等因素，筛选出满足一定基本面要求的股票，构建备选股票池。然后，综合考虑股票的估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子，对股票进行综合评价后，挑选符合一定标准的股票用于构建股票组合。最后，利用投资组合优化工具，最大化组合的预期收益，以此来确定个股的投资权重，并根据市场的变化及时调整投资组合，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金的股指期货投资策略、

	债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、参与融资业务的策略和存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中信成长风格指数收益率×90%+同期银行活期存款利率(税后)×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博道基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛
	联系电话	021-80226288
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn
客户服务电话	400-085-2888	95575
传真	021-80226289	020-87553363-6847
注册地址	上海市虹口区东大名路1158号301室	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码	200122	510627
法定代表人	莫泰山	林传辉

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
注册登记机构	博道基金管理有限公司	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年		2022年		2021年10月26日 (基金合同生效日) - 2021年12月31日	
	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C
本期已实现收益	46,433,595.91	32,956,925.47	-241,438,852.17	-178,751,311.78	6,455,186.26	3,596,452.02
本期利润	110,650,924.15	65,472,143.13	-307,062,982.22	-226,241,228.19	11,540,031.33	7,274,829.20
加权平均基金份额本期利润	0.0869	0.0418	-0.2212	-0.2299	0.0071	0.0062
本期加权平均净值利润率	9.79%	4.75%	-25.76%	-26.86%	0.71%	0.62%
本期基金份额净值增长率	11.31%	10.76%	-20.14%	-20.53%	0.71%	0.62%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末		2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	-158,182,893.76	-296,707,119.21	-240,707,427.97	-174,330,464.19	6,455,186.26	3,596,452.02
期末可供分配基金份额利润	-0.1107	-0.1203	-0.1957	-0.2004	0.0040	0.0031

期末基金资产净值	1,279,425,053.15	2,184,405,160.20	989,564,977.94	695,584,172.06	1,632,933,027.73	1,179,255,258.94
期末基金份额净值	0.8953	0.8856	0.8043	0.7996	1.0071	1.0062
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2023年末		2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	-10.47%	-11.44%	-19.57%	-20.04%	0.71%	0.62%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博道成长智航股票A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.08%	0.98%	-2.63%	1.05%	2.71%	-0.07%
过去六个月	-4.19%	1.00%	-12.15%	1.03%	7.96%	-0.03%
过去一年	11.31%	0.97%	-5.69%	1.02%	17.00%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-10.47%	1.23%	-25.26%	1.24%	14.79%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

博道成长智航股票C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.06%	0.98%	-2.63%	1.05%	2.57%	-0.07%
过去六个月	-4.44%	1.00%	-12.15%	1.03%	7.71%	-0.03%
过去一年	10.76%	0.97%	-5.69%	1.02%	16.45%	-0.05%
自基金合同	-11.44%	1.23%	-25.26%	1.24%	13.82%	-0.01%



生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博道成长智航股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年10月26日-2023年12月31日)



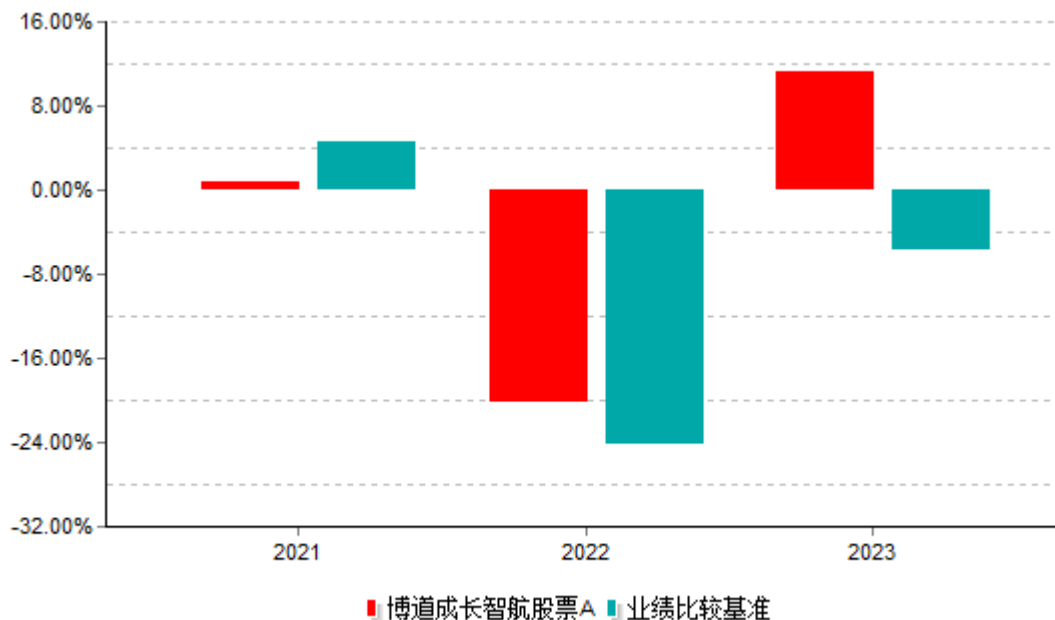
注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

博道成长智航股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年10月26日-2023年12月31日)

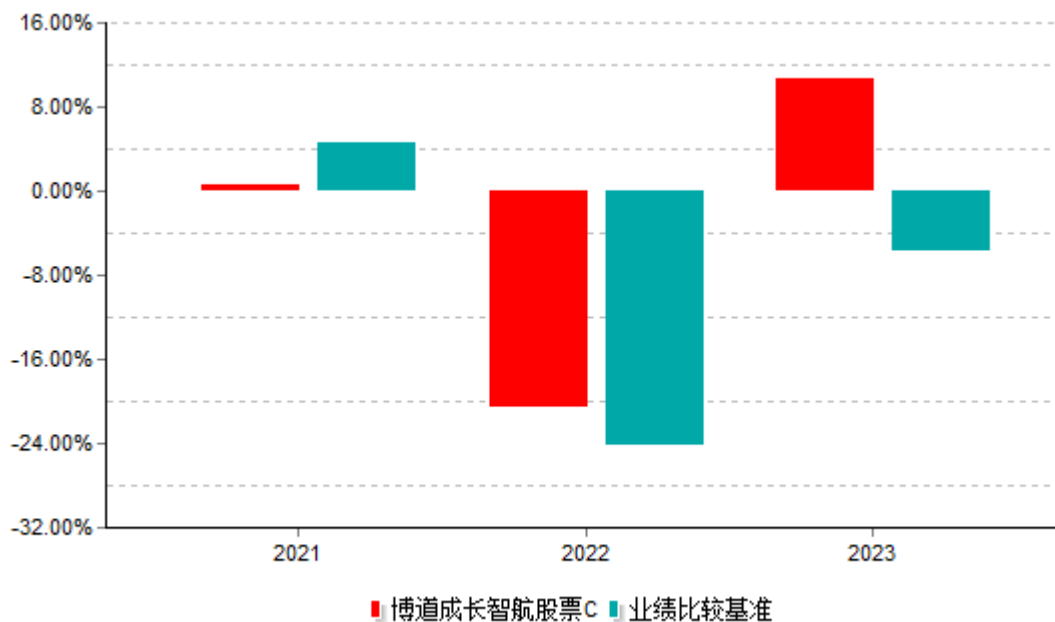


注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。



注：基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可[2017]822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了28只公募基金：博道启航混合型证券投资基金、博道卓远混合型证券投资基金、博道中证500指数增强型证券投资基金、博道沪深300指数增强型证券投资基金、博道远航混合型证券投资基金、博道叁佰智航股票型证券投资基金、博道志远混合型证券投资基金、博道伍佰智航股票型证券投资基金、博道嘉泰回报混合型证券投资基金、博道久航混合型证券投资基金、博道嘉瑞混合型证券投资基金、博道安远6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉元混合型证券投资基金、博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金、博道睿见一年持有期混合型证券投资基金、博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉丰混合型证券投资基金、博道消费智航股票型证券投资基金、博道盛彦混合型证券投资基金、博道成长智航股票型证券投资基金、博道盛兴一年持有期混合型证券投资基金、博道研究恒选混合型证券投资基金、博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金、博道惠泰优选混合型证券投资基金、博道和祥多元稳健债券型证券投资基金、博道中证1000指数增强型证券投资基金、博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金和博道红利智航股票型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨梦	博道启航混合、博道中证500增强、博道沪深300增强、博道远航混合、博道叁佰	2021-10-26	-	12年	杨梦女士，中国籍，经济学硕士。2011年7月至2014年6月担任农银汇理基金管理有限公司量化研究员，2014

	<p>智航、博道伍佰智航、博道久航混合、博道消费智航、博道成长智航股票、博道中证1000指数增强、博道红利智航股票的基金经理、量化投资部总经理、研究部副总经理</p>			<p>年6月至2014年11月担任华泰资产管理有限公司量化研究员，2014年11月至2017年7月担任上海博道投资管理有限公司投资经理助理、投资经理。2017年8月加入博道基金管理有限公司，现任量化投资部总经理兼研究部副总经理。具有基金从业资格。自2018年8月10日起担任博道启航混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年1月3日起担任博道中证500指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2019年4月26日起担任博道沪深300指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2019年4月30日起担任博道远航混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年6月5日起担任博道叁佰智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2019年9月26日起担任博道伍佰智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2019年12月24日起担任博道久航混合型证券投资基金基金经理至今、自2021年5月7日起担任博道消费智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2021年10月26日起担任博道成长智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2023年</p>
--	---	--	--	--

					8月25日起担任博道中证1000指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2023年10月31日起担任博道红利智航股票型证券投资基金基金经理至今。
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，"任职日期"和"离职日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下所管理的所有资产组合投资运作的公平。旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下：

(1) 公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，遵循"时间优先、价格优先、比例分配"的原则，全部通过交易系统按比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循"价格优先、比例分配"的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

(3) 公司建立了清晰的授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益，保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

(4) 公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5) 公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各投资组合公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现违反公平交易制度的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生10次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年，国内经济和海外流动性两大因素主导市场波动，各指数在低估区域继续弱势。全年沪深300下跌11.38%，中证500下跌7.42%，中证1000下跌6.28%，上证指数下跌3.70%，创业板指下跌19.41%，恒生指数下跌13.82%。从行业来看，通信、传媒、煤炭表现较好，分别上涨了24.78%、19.84%、13.39%，消费者服务、房地产、电力设备新能源表现较差，分别下跌41.18%、24.80%、24.65%。

从因子层面来看，2023年是个非“典型”年份，基本面类的因子全年表现都相对弱势，在传统容易有所表现的二、三季度并未录得较好超额，在容易波动的四季度反而表现相对平稳；而估值因子和量价因子因表征反转逻辑，在存量博弈的2023年持续表现亮眼。博道“指数+”系列产品在相对均衡的因子权重配置下，持续深耕底层大类因子的有效迭代，全年超额表现较好。2023年二季度开始，博道量化团队进行了AI全流程投资模型的研发，并在三季度陆续开始在各量化产品中进行运用，10月底开始，传统框架多因子模型与AI全流程多因子模型以各自约一半的权重参与博道“指数+”系列产品的实盘。

报告期间，本基金维持配置中信成长风格指数多因子选股增强模型。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金份额净值及业绩表现请见"3.1 主要会计数据和财务指标"及"3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较"部分披露。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024年，基于赔率的视角，股市股权风险溢价再度达到2倍标准差的水平，债券市场的期限利率和信用利差也已经被压到极致；基于胜率的视角，我们监测的股票市场基本面从时间和空间的角度都已大概率接近底部。虽然很难精准预测股债资产溢价何时回归，但方向是明确的，耐心更加可贵。

本基金将继续坚持量化多因子的选股思路，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023年度，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》等有关法规，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化监察稽核职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）持续完善公司内部控制制度和业务流程，推动制度流程的及时更新。

公司持续以提升制度和业务流程的指导性和执行力为强化内部控制的重要抓手，以内部管理制度的全面修订和公司主要业务流程的梳理为工作重点。结合本报告期新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，贯彻落实新法规及新的监管要求。公司着重关注于公司的核心增值流程，通过对流程的研究、梳理、再造等过程实现管理上风险和回报的平衡。

（二）深化事前事中合规及风险管理，提高合规管理及风险控制有效性。

强化事前事中合规审查，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料等，着力防范各类合规风险。在风险管理方面，夯实事前防范、事中控制和事后监督等各阶段工作，重点加强对信用风险、流动性风险等风险的管理。

（三）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司监察稽核部坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察。通过对基金投资、销售、运营等部门的内部控制关键点进行定期和不定期检查，促进公司内部控制制度规范、执行有效，风险管理水平不断提升。

(四) 强化培训教育，持续提高全员风险合规意识。

公司积极推动各项新法规落实和风险合规教育工作。通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由营运分管领导、督察长、基金事务部负责人、投委会主席、研究部负责人、投资运营部负责人、监察稽核部负责人及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的投资研究相关人员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司估值委员会审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对博道成长智航股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。



## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，博道基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对博道基金管理有限公司编制和披露的博道成长智航股票型证券投资基金2023年年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第26528号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	博道成长智航股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了博道成长智航股票型证券投资基金(以下简称“博道成长智航股票基金”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行</p>

	业实务操作编制，公允反映了博道成长智航股票基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博道成长智航股票基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>博道成长智航股票基金的基金管理人博道基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估博道成长智航股票基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博道成长智航股票基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督博道成长智航股票基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于</p>

舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对博道成长智航股票基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博道成长智航股票基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟

	通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	叶尔甸、李隐煜
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
审计报告日期	2024-03-22

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博道成长智航股票型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	103,373,946.22	67,407,910.62
结算备付金		4,781.19	4,709.20
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	3,362,562,510.24	1,621,981,672.75
其中：股票投资		3,183,540,614.03	1,540,183,865.96
基金投资		-	-
债券投资		179,021,896.21	81,797,806.79
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		10,279,993.44	193,980.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		3,476,221,231.09	1,689,588,273.23
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	291.00
应付赎回款		7,270,516.04	1,342,356.72
应付管理人报酬		3,442,158.18	2,218,224.79
应付托管费		573,693.04	369,704.11
应付销售服务费		904,400.72	305,948.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.41	1.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	200,249.35	202,596.70
负债合计		12,391,017.74	4,439,123.23
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	3,895,685,108.37	2,100,187,042.16
未分配利润	7.4.7.8	-431,854,895.02	-415,037,892.16
净资产合计		3,463,830,213.35	1,685,149,150.00
负债和净资产总计		3,476,221,231.09	1,689,588,273.23

注：报告截止日2023年12月31日，A类基金份额净值0.8953元，C类基金份额净值0.8856元；基金份额总额3,895,685,108.37份，其中A类基金份额1,429,086,140.62份，C类基金份额2,466,598,967.75份。

## 7.2 利润表

会计主体：博道成长智航股票型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
一、营业总收入		222,681,073.78	-493,184,810.97
1.利息收入		471,334.41	472,500.07
其中：存款利息收入	7.4.7.9	471,333.57	472,453.02
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		0.84	47.05
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		124,658,523.01	-381,377,565.38
其中：股票投资收益	7.4.7.10	99,618,200.95	-397,750,659.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	3,626,692.07	2,191,033.57
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	21,413,629.99	14,182,060.62
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.15	96,732,545.90	-113,114,046.46
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号	7.4.7.16	818,670.46	834,300.80

填列)			
<b>减：二、营业总支出</b>		46,558,006.50	40,119,399.44
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	33,878,054.24	30,596,181.48
2.托管费	7.4.10.2.2	5,646,342.41	5,099,363.63
3.销售服务费		6,820,144.30	4,223,852.49
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		13,450.35	-
其中：卖出回购金融资产支出		13,450.35	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		15.20	1.84
8.其他费用	7.4.7.17	200,000.00	200,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		176,123,067.28	-533,304,210.41
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		176,123,067.28	-533,304,210.41
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		176,123,067.28	-533,304,210.41

### 7.3 净资产变动表

会计主体：博道成长智航股票型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,100,187,042.16	-415,037,892.16	1,685,149,150.00
二、本期期初净资产	2,100,187,042.16	-415,037,892.16	1,685,149,150.00

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,795,498,066.21	-16,817,002.86	1,778,681,063.35
（一）、综合收益总额	-	176,123,067.28	176,123,067.28
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,795,498,066.21	-192,940,070.14	1,602,557,996.07
其中：1.基金申购款	2,872,520,279.33	-322,271,085.70	2,550,249,193.63
2.基金赎回款	-1,077,022,213.12	129,331,015.56	-947,691,197.56
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	3,895,685,108.37	-431,854,895.02	3,463,830,213.35
项目	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,793,373,426.14	18,814,860.53	2,812,188,286.67
二、本期期初净资产	2,793,373,426.14	18,814,860.53	2,812,188,286.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-693,186,383.98	-433,852,752.69	-1,127,039,136.67
（一）、综合收益	-	-533,304,210.41	-533,304,210.41



总额			
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-693,186,383.98	99,451,457.72	-593,734,926.26
其中: 1.基金申购款	148,949,243.57	-22,901,809.19	126,047,434.38
2.基金赎回款	-842,135,627.55	122,353,266.91	-719,782,360.64
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	2,100,187,042.16	-415,037,892.16	1,685,149,150.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

莫泰山

张丽

严娅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

博道成长智航股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]2858号《关于准予博道成长智航股票型证券投资基金注册的批复》注册,由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道成长智航股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,792,493,565.87元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0983号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博道成长智航股票型证券投资基金基金合同》于2021年10月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额

为2,793,373,426.14份基金份额，其中认购资金利息折合879,860.27份基金份额。本基金的基金管理人为博道基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《博道成长智航股票型证券投资基金基金合同》和《博道成长智航股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道成长智航股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中信成长风格指数收益率×90%+同期银行活期存款利率(税后)×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人博道基金管理有限公司于2024年3月22日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博道成长智航股票型证券投资基金基

金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

###### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证

券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种, 根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外), 按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:



(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	3,290,992.31	3,301,620.99
等于：本金	3,290,186.86	3,300,807.42
加：应计利息	805.45	813.57
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-

减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	100,082,953.91	64,106,289.63
等于：本金	100,069,525.78	64,098,497.40
加：应计利息	13,428.13	7,792.23
减：坏账准备	-	-
合计	103,373,946.22	67,407,910.62

注：其他存款本期末及上年度末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	3,191,357,971.34	-	3,183,540,614.03	-7,817,357.31	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	177,317,329.53	1,505,487.68	179,021,896.21	199,079.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	177,317,329.53	1,505,487.68	179,021,896.21	199,079.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	3,368,675,300.87	1,505,487.68	3,362,562,510.24	-7,618,278.31	

项目		上年度末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,644,490,268.17	-	1,540,183,865.96	-104,306,402.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	80,217,418.83	1,624,809.96	81,797,806.79	-44,422.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	80,217,418.83	1,624,809.96	81,797,806.79	-44,422.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,724,707,687.00	1,624,809.96	1,621,981,672.75	-104,350,824.21

注：如果本报告期末或上年度末本基金持有中国存托凭证，则股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 其他资产

无。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	249.35	2,596.70
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	80,000.00	80,000.00
预提费用-信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	200,249.35	202,596.70

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 博道成长智航股票A

金额单位：人民币元

项目 (博道成长智航股票A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,230,272,405.91	1,230,272,405.91
本期申购	568,001,969.87	568,001,969.87
本期赎回（以“-”号填列）	-369,188,235.16	-369,188,235.16
本期末	1,429,086,140.62	1,429,086,140.62

##### 7.4.7.7.2 博道成长智航股票C

金额单位：人民币元

项目 (博道成长智航股票C)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	869,914,636.25	869,914,636.25
本期申购	2,304,518,309.46	2,304,518,309.46
本期赎回（以“-”号填列）	-707,833,977.96	-707,833,977.96

本期末	2,466,598,967.75	2,466,598,967.75
-----	------------------	------------------

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 博道成长智航股票A

单位：人民币元

项目 (博道成长智航股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-184,653,365.48	-56,054,062.49	-240,707,427.97
本期期初	-184,653,365.48	-56,054,062.49	-240,707,427.97
本期利润	46,433,595.91	64,217,328.24	110,650,924.15
本期基金份额交易产生的变动数	-19,963,124.19	358,540.54	-19,604,583.65
其中：基金申购款	-62,229,983.38	1,915,140.68	-60,314,842.70
基金赎回款	42,266,859.19	-1,556,600.14	40,710,259.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-158,182,893.76	8,521,806.29	-149,661,087.47

##### 7.4.7.8.2 博道成长智航股票C

单位：人民币元

项目 (博道成长智航股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-134,910,522.86	-39,419,941.33	-174,330,464.19
本期期初	-134,910,522.86	-39,419,941.33	-174,330,464.19
本期利润	32,956,925.47	32,515,217.66	65,472,143.13
本期基金份额交易产生的变动数	-194,753,521.82	21,418,035.33	-173,335,486.49
其中：基金申购款	-279,291,767.11	17,335,524.11	-261,956,243.00
基金赎回款	84,538,245.29	4,082,511.22	88,620,756.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-296,707,119.21	14,513,311.66	-282,193,807.55

**7.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	31,927.42	30,505.97
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	439,334.16	430,765.65
结算备付金利息收入	71.99	11,181.40
其他	-	-
合计	471,333.57	472,453.02

**7.4.7.10 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	24,058,368,654.91	18,863,786,796.45
减：卖出股票成本总额	23,910,268,886.92	19,220,289,596.75
减：交易费用	48,481,567.04	41,247,859.27
买卖股票差价收入	99,618,200.95	-397,750,659.57

**7.4.7.11 债券投资收益****7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	1,864,832.30	1,362,911.53
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付)	1,761,859.77	828,122.04

差价收入		
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	3,626,692.07	2,191,033.57

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	179,319,091.75	3,933,085.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	174,420,409.47	3,103,957.19
减：应计利息总额	3,135,092.63	518.91
减：交易费用	1,729.88	487.76
买卖债券差价收入	1,761,859.77	828,122.04

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日

股票投资产生的股利收益	21,413,629.99	14,182,060.62
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	21,413,629.99	14,182,060.62

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	96,732,545.90	-113,114,046.46
——股票投资	96,489,044.90	-113,069,624.46
——债券投资	243,501.00	-44,422.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	96,732,545.90	-113,114,046.46

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
基金赎回费收入	794,244.51	833,302.23
转换费收入	24,425.95	998.57
合计	818,670.46	834,300.80



注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，其中A类份额将不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类份额将赎回费收入全额归入基金资产。

2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中，A类份额将不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产，C类份额将转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	200,000.00	200,000.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博道基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
广发证券股份有限公司("广发证券")	基金托管人、基金销售机构
上海博道投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海博道如思投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如见投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如舍投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如知投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
莫泰山	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	19,531,258,867.69	39.47%	14,787,800,440.51	39.81%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	114,299,094.88	40.64%	33,577,998.20	39.99%

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期债券回

		购成交 总额的 比例		购成交 总额的 比例
广发证券	130,004,000.00	99.99%	3,000.00	0.30%

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
广发证券	9,988,170.24	39.11%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
广发证券	7,715,143.72	39.78%	-	-

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商，为本基金证券交易提供支持服务。上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	33,878,054.24	30,596,181.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,230,395.01	12,256,981.60
应支付基金管理人的净管理费	23,647,659.23	18,339,199.88

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%/1.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、根据基金管理人发布的《博道基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》,自2023年8月14日起,本基金管理费率由1.50%调整为1.20%。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,646,342.41	5,099,363.63

注:1、支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%/0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、根据基金管理人发布的《博道基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》,自2023年8月14日起,本基金托管费率由0.25%调整为0.20%。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C	合计
博道基金管理有限公司	0.00	2,304,127.35	2,304,127.35
广发证券	0.00	951,101.03	951,101.03
合计	0.00	3,255,228.38	3,255,228.38
获得销售服务费的	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		

各关联方 名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C	合计
博道基金 管理有限 公司	0.00	4,744.79	4,744.79
广发证券	0.00	991,069.24	991,069.24
合计	0.00	995,814.03	995,814.03

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日C类基金份额对应的基金资产净值×0.50%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博道成长智航股票A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年12月31日
报告期初持有的基金份额	5,205,376.24	2,000,480.18
报告期间申购/买入总份额	-	3,204,896.06
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,205,376.24	5,205,376.24
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.36%	0.42%

博道成长智航股票C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至 2023年12月31日	2022年01月01日至 2022年12月31日
报告期初持有的基金份额	1,000,540.00	1,000,540.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,000,540.00	1,000,540.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.04%	0.12%

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；  
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；  
3、如果本报告期间发生认购、申购、转换入、红利再投、赎回、转换出等业务，本基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

上海博道投资管理有限公司及本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间大于100万份。（上年度末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间50~100万份。）

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券	50,543,940.04	194,727.77	26,102,144.47	177,539.54

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于基金托管人基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年12月31日				
关联方名	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

称				数量(单位:张/股)	总金额
广发证券	688343	云天励飞-U	网下发行	24,961	1,096,287.12
广发证券	301376	致欧科技	网下发行	4,192	103,374.72
广发证券	301357	北方长龙	网下发行	1,900	95,000.00
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:张/股)	总金额
广发证券	301220	亚香股份	网下发行	2,849	102,507.02
广发证券	688496	清越科技	网下发行	12,000	109,920.00

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末(2023年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688563	航材股份	2023-07-12	6个月以上	科创板打新限售	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688548	广钢气体	2023-08-0	6个月以上	科创板打	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-

		8		新限售							
603296	华勤技术	2023-08-01	6个月以上	主板打新限售	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-	
301526	国际复材	2023-12-19	6个月以上	创业板打新限售	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-	
301487	盟固利	2023-08-01	6个月以上	创业板打新限售	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-	
688549	中巨芯	2023-08-30	6个月以上	科创板打新限售	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-	
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月以上	创业板打新限售	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-	
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6个月以上	创业板打新限售	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-	
688702	盛科通信	2023-09-06	6个月以上	科创板打新限售	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-	
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月以上	科创板打新限售	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-	



301559	中集环科	2023-09-26	6个月以上	创业板打新限售	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6个月以上	科创板打新限售	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月以上	创业板打新限售	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6个月以上	创业板打新限售	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月以上	创业板打新限售	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6个月以上	创业板打新限售	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301421	波长光电	2023-08-16	6个月以上	创业板打新限售	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301558	三态股份	2023-09-21	6个月以上	创业板打新限售	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
688627	精智	2023-07-1	6个月以	科创	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-

	达	1	上	板打 新限售							
3009 04	威力 传动	2023 -08-0 2	6个月以 上	创业 板打 新限售	35.41	61.53	304	10,76 4.64	18,70 5.12	-	
3014 88	豪恩 汽电	2023 -06-2 6	6个月以 上	创业 板打 新限售	39.78	69.09	262	10,42 2.36	18,10 1.58	-	
3014 68	博盈 特焊	2023 -07-1 2	6个月以 上	创业 板打 新限售	47.58	30.22	598	28,45 2.84	18,07 1.56	-	
3011 72	君逸 数码	2023 -07-1 9	6个月以 上	创业 板打 新限售	31.33	38.16	438	13,72 2.54	16,71 4.08	-	
3015 09	金凯 生科	2023 -07-2 6	6个月以 上	创业 板打 新限售	56.56	62.23	266	15,04 4.96	16,55 3.18	-	
3013 62	民爆 光电	2023 -07-2 7	6个月以 上	创业 板打 新限售	51.05	38.52	420	21,44 1.00	16,17 8.40	-	
6886 12	威迈 斯	2023 -07-1 9	6个月以 上	科创 板打 新限售	47.29	37.97	422	19,95 6.38	16,02 3.34	-	
6010 96	宏盛 华源	2023 -12-1 5	6个月以 上	主板 打新 限售	1.70	4.06	3,918	6,66 0.60	15,90 7.08	-	

301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月以上	创业板打新限售	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
688610	埃科光电	2023-07-10	6个月以上	科创板打新限售	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6个月以上	主板打新限售	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
301510	固高科技	2023-08-04	6个月以上	创业板打新限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301507	民生健康	2023-08-24	6个月以上	创业板打新限售	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月以上	创业板打新限售	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	创业板打新限售	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月以上	创业板打新限售	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月以上	科创板打	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-

				新限售							
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月以上	科创板打新限售	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-	
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月以上	创业板打新限售	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-	
301508	中机认检	2023-11-23	6个月以上	创业板打新限售	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-	
301251	威尔高	2023-08-30	6个月以上	创业板打新限售	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-	
688592	司南导航	2023-08-07	6个月以上	科创板打新限售	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-	
301499	维科精密	2023-07-13	6个月以上	创业板打新限售	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-	
688603	天承科技	2023-06-30	6个月以上	科创板打新限售	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-	
688653	康希通信	2023-11-10	6个月以上	科创板打新限售	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-	

301528	多浦乐	2023-08-17	6个月以上	创业板打新限售	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301329	信音电子	2023-07-05	6个月以上	创业板打新限售	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301372	科净源	2023-08-03	6个月以上	创业板打新限售	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月以上	创业板打新限售	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月以上	创业板打新限售	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
688716	中研股份	2023-09-13	6个月以上	科创板打新限售	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
301413	安培龙	2023-12-11	6个月以上	创业板打新限售	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月以上	创业板打新限售	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301418	协昌	2023-08-1	6个月以	创业	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-

	科技	0	上	板打 新限售							
3015 16	中远 通	2023 -12-0 1	6个月以 上	创业 板打 新限售	6.87	15.51	604	4,14 9.48	9,36 8.04	-	
3012 72	英华 特	2023 -07-0 6	6个月以 上	创业 板打 新限售	51.39	53.38	173	8,89 0.47	9,23 4.74	-	
3014 69	恒达 新材	2023 -08-1 0	6个月以 上	创业 板打 新限售	36.58	33.09	275	10,05 9.50	9,09 9.75	-	
3015 19	舜禹 股份	2023 -07-1 9	6个月以 上	创业 板打 新限售	20.93	20.21	442	9,25 1.06	8,93 2.82	-	
3015 18	长华 化学	2023 -07-2 6	6个月以 上	创业 板打 新限售	25.75	23.01	385	9,91 3.75	8,85 8.85	-	
3015 68	思泰 克	2023 -11-2 1	6个月以 上	创业 板打 新限售	23.23	35.58	246	5,71 4.58	8,75 2.68	-	
3015 20	万邦 医药	2023 -09-1 8	6个月以 上	创业 板打 新限售	67.88	52.74	160	10,86 0.80	8,43 8.40	-	
3014 59	丰茂 股份	2023 -12-0 6	6个月以 上	创业 板打 新限售	31.90	39.84	208	6,63 5.20	8,28 6.72	-	

				售							
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月以上	科创板打新限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-	
688573	信宇人	2023-08-09	6个月以上	科创板打新限售	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-	
301489	思泉新材	2023-10-16	6个月以上	创业板打新限售	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-	
688651	盛邦安全	2023-07-19	6个月以上	科创板打新限售	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-	
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月以上	创业板打新限售	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-	
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月以上	创业板打新限售	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-	
301548	崇德科技	2023-09-11	6个月以上	创业板打新限售	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-	
688657	浩辰软件	2023-09-25	6个月以上	科创板打新限售	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-	

688646	逸飞激光	2023-07-21	6个月以上	科创板打新限售	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6个月以上	科创板打新限售	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023-08-10	6个月以上	科创板打新限售	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
603275	众辰科技	2023-08-16	6个月以上	主板打新限售	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
301533	威马农机	2023-08-07	6个月以上	创业板打新限售	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6个月以上	主板打新限售	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6个月以上	创业板打新限售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月以上	创业板打新限售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301529	福赛科技	2023-08-31	6个月以上	创业板打新限售	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-



				售							
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月以上	创业板打新限售	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-	
688648	中邮科技	2023-11-06	6个月以上	科创板打新限售	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-	
001378	德冠新材	2023-10-23	6个月以上	主板打新限售	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-	
688450	光格科技	2023-07-17	6个月以上	科创板打新限售	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-	
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月以上	主板打新限售	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-	
603270	金帝股份	2023-08-25	6个月以上	主板打新限售	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-	
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6个月以上	主板打新限售	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-	
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月以上	主板打新限售	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-	
603193	润本股份	2023-10-09	6个月以上	主板打新限售	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-	
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月以上	主板打新	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-	

				限售						
0013 26	联域 股份	2023 -11-0 1	6个月以 上	主板 打新 限售	41.18	48.64	99	4,07 6.82	4,81 5.36	-
6030 75	热威 股份	2023 -09-0 1	6个月以 上	主板 打新 限售	23.10	23.31	182	4,20 4.20	4,24 2.42	-
0012 39	永达 股份	2023 -12-0 4	6个月以 上	主板 打新 限售	12.05	19.92	189	2,27 7.45	3,76 4.88	-
6032 31	索宝 蛋白	2023 -12-0 6	6个月以 上	主板 打新 限售	21.29	21.53	161	3,42 7.69	3,46 6.33	-
6032 73	天元 智能	2023 -10-1 6	6个月以 上	主板 打新 限售	9.50	18.97	178	1,69 1.00	3,37 6.66	-
6032 76	恒兴 新材	2023 -09-1 8	6个月以 上	主板 打新 限售	25.73	24.88	134	3,44 7.82	3,33 3.92	-
6033 73	安邦 护卫	2023 -12-1 3	6个月以 上	主板 打新 限售	19.10	34.75	88	1,68 0.80	3,05 8.00	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	受限期	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (单 位:张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
1232 36	家联 转债	2023 -12-2 2	1个月内 (含)	配债 未上 市	100.0 0	100.0 0	3,345	334,4 98.53	334,5 13.19	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人广发证券开立于中国工商银行股份有限公司的托管账户，其他存款存放于方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司和海通证券股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2023年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.01%(2022年12月31日：0.01%)。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2023年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2023年12月31日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.05%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变

现价值。于2023年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为3,467,278,352.54元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	103,373,946.22	-	-	-	-	-	103,373,946.22
结算备	4,781.19	-	-	-	-	-	4,781.19

付金							
交易性金融资产	-	-	178,687,383.02	-	334,513.19	3,183,540,614.03	3,362,562,510.24
应收申购款	-	-	-	-	-	10,279,993.44	10,279,993.44
资产总计	103,378,727.41	-	178,687,383.02	-	334,513.19	3,193,820,607.47	3,476,221,231.09
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,270,516.04	7,270,516.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,442,158.18	3,442,158.18
应付托管费	-	-	-	-	-	573,693.04	573,693.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	904,400.72	904,400.72
应交税费	-	-	-	-	-	0.41	0.41
其他负债	-	-	-	-	-	200,249.35	200,249.35
负债总计	-	-	-	-	-	12,391,017.74	12,391,017.74
利率敏感度缺口	103,378,727.41	-	178,687,383.02	-	334,513.19	3,181,429,589.73	3,463,830,213.35
上年度末 2022年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	67,407,910.62	-	-	-	-	-	67,407,910.62
结算备付金	4,709.20	-	-	-	-	-	4,709.20
交易性金融资产	81,616,767.12	-	-	-	181,039.67	1,540,183,865.96	1,621,981,672.75
应收申	-	-	-	-	-	193,980.66	193,980.66

购款							
资产总计	149,029,386.94	-	-	-	181,039.67	1,540,377,846.62	1,689,588,273.23
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	291.00	291.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,342,356.72	1,342,356.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,218,224.79	2,218,224.79
应付托管费	-	-	-	-	-	369,704.11	369,704.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	305,948.50	305,948.50
应交税费	-	-	-	-	-	1.41	1.41
其他负债	-	-	-	-	-	202,596.70	202,596.70
负债总计	-	-	-	-	-	4,439,123.23	4,439,123.23
利率敏感度缺口	149,029,386.94	-	-	-	181,039.67	1,535,938,723.39	1,685,149,150.00

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为5.17%(2022年12月31日：4.85%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022年12月31日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上

市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产不低于基金资产的80%，保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,183,540,614.03	91.91	1,540,183,865.96	91.40
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-



合计	3,183,540,614.03	91.91	1,540,183,865.96	91.40
----	------------------	-------	------------------	-------

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中信成长风格指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1.中信成长风格指数收益率上升5%	151,434,215.26	72,165,844.54
	2.中信成长风格指数收益率下降5%	-151,434,215.26	-72,165,844.54

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	3,182,217,249.84	1,536,352,855.83
第二层次	179,021,896.21	81,797,806.79
第三层次	1,323,364.19	3,831,010.13
合计	3,362,562,510.24	1,621,981,672.75

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,831,010.13	3,831,010.13
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,027,300.54	3,027,300.54
转出第三层次	-	7,032,264.67	7,032,264.67
当期利得或损失总额	-	1,497,318.19	1,497,318.19
其中：计入损益的利得或损失	-	1,497,318.19	1,497,318.19
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,323,364.19	1,323,364.19
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	146,273.56	146,273.56
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计

	债券投资	股票投资	
期初余额	-	364,321.44	364,321.44
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	11,248,371.37	11,248,371.37
转出第三层次	-	11,022,915.63	11,022,915.63
当期利得或损失总额	-	3,241,232.95	3,241,232.95
其中：计入损益的利得或损失	-	3,241,232.95	3,241,232.95
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,831,010.13	3,831,010.13
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	138,996.88	138,996.88

注：1.于本报告期末，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本报告期，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

2.计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期内股票投资	1,323,364.19	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.62%-21.9.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

限售期内股票投资	3,831,010.13	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.91%-24 7.56%	负相关
----------	--------------	------------	-------	--------------------	-----

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,183,540,614.03	91.58
	其中：股票	3,183,540,614.03	91.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	179,021,896.21	5.15
	其中：债券	179,021,896.21	5.15
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	103,378,727.41	2.97
8	其他各项资产	10,279,993.44	0.30
9	合计	3,476,221,231.09	100.00

注：银行存款和结算备付金合计余额包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	17,882,780.00	0.52
C	制造业	2,414,542,282.32	69.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,055,198.83	1.39
E	建筑业	24,872,238.00	0.72
F	批发和零售业	20,220,548.40	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	35,910,940.24	1.04
H	住宿和餐饮业	9,115,796.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	492,845,614.72	14.23
J	金融业	19,035,505.00	0.55
K	房地产业	11,223,569.00	0.32
L	租赁和商务服务业	13,076,480.40	0.38
M	科学研究和技术服务业	33,422,286.41	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	5,205,946.71	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,475,910.00	0.19
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	31,655,518.00	0.91
S	综合	-	-
	合计	3,183,540,614.03	91.91

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	474,593	77,482,053.18	2.24
2	002415	海康威视	1,481,529	51,438,686.88	1.49
3	000100	TCL科技	6,142,000	26,410,600.00	0.76
4	002555	三七互娱	1,265,400	23,802,174.00	0.69
5	000063	中兴通讯	863,600	22,868,128.00	0.66
6	300566	激智科技	1,214,656	22,689,774.08	0.66
7	600038	中直股份	576,373	22,207,651.69	0.64
8	688208	道通科技	925,139	21,972,051.25	0.63
9	688049	炬芯科技	574,573	21,873,994.11	0.63
10	002452	长高电新	2,909,800	20,659,580.00	0.60
11	002879	长缆科技	1,268,826	20,326,592.52	0.59
12	002449	国星光电	2,103,800	19,922,986.00	0.58
13	688689	银河微电	712,645	19,861,416.15	0.57
14	603507	振江股份	761,700	19,735,647.00	0.57
15	603486	科沃斯	472,400	19,576,256.00	0.57
16	300790	宇瞳光学	1,155,900	18,806,493.00	0.54
17	300687	赛意信息	863,197	18,800,430.66	0.54
18	605058	澳弘电子	807,600	18,502,116.00	0.53
19	300922	天秦装备	1,072,400	18,305,868.00	0.53
20	300682	朗新集团	1,107,100	18,145,369.00	0.52
21	002273	水晶光电	1,337,100	18,104,334.00	0.52
22	605288	凯迪股份	381,600	17,980,992.00	0.52
23	688510	航亚科技	1,008,647	17,772,360.14	0.51
24	002823	凯中精密	1,391,289	17,669,370.30	0.51
25	601218	吉鑫科技	4,400,700	17,602,800.00	0.51
26	603236	移远通信	321,560	17,283,850.00	0.50
27	600637	东方明珠	2,260,100	16,995,952.00	0.49

28	002475	立讯精密	484,900	16,704,805.00	0.48
29	300889	爱克股份	976,100	16,398,480.00	0.47
30	300286	安科瑞	628,800	16,304,784.00	0.47
31	605066	天正电气	1,726,700	15,851,106.00	0.46
32	300823	建科机械	734,100	15,790,491.00	0.46
33	603045	福达合金	997,500	15,750,525.00	0.45
34	002410	广联达	916,400	15,707,096.00	0.45
35	300626	华瑞股份	1,437,500	15,596,875.00	0.45
36	002947	恒铭达	476,681	15,339,594.58	0.44
37	688127	蓝特光学	655,617	15,269,319.93	0.44
38	002296	辉煌科技	1,845,400	15,224,550.00	0.44
39	300543	朗科智能	1,391,550	15,195,726.00	0.44
40	605258	协和电子	520,600	14,457,062.00	0.42
41	605376	博迁新材	511,600	14,427,120.00	0.42
42	300219	鸿利智汇	1,706,700	14,370,414.00	0.41
43	002649	博彦科技	1,167,700	14,327,679.00	0.41
44	300014	亿纬锂能	339,108	14,310,357.60	0.41
45	300996	普联软件	619,400	14,184,260.00	0.41
46	301042	安联锐视	357,200	14,002,240.00	0.40
47	603039	泛微网络	293,000	13,741,700.00	0.40
48	603063	禾望电气	538,800	13,470,000.00	0.39
49	002730	电光科技	1,404,900	13,318,452.00	0.38
50	002625	光启技术	893,400	13,204,452.00	0.38
51	002212	天融信	1,345,800	13,161,924.00	0.38
52	603989	艾华集团	610,300	13,133,656.00	0.38
53	300348	长亮科技	1,272,700	13,121,537.00	0.38
54	601390	中国中铁	2,296,400	13,043,552.00	0.38
55	002891	中宠股份	492,300	12,972,105.00	0.37
56	300872	天阳科技	945,300	12,931,704.00	0.37
57	002469	三维化学	2,113,300	12,806,598.00	0.37
58	605208	永茂泰	1,329,000	12,625,500.00	0.36

59	300274	阳光电源	143,600	12,577,924.00	0.36
60	603056	德邦股份	869,189	12,577,164.83	0.36
61	301041	金百泽	464,100	12,539,982.00	0.36
62	300017	网宿科技	1,596,100	12,529,385.00	0.36
63	002472	双环传动	478,900	12,460,978.00	0.36
64	603232	格尔软件	902,800	12,359,332.00	0.36
65	601500	通用股份	2,975,400	12,318,156.00	0.36
66	300124	汇川技术	194,898	12,305,859.72	0.36
67	601012	隆基绿能	537,112	12,299,864.80	0.36
68	688687	凯因科技	351,406	12,250,013.16	0.35
69	300701	森霸传感	1,060,800	12,177,984.00	0.35
70	300088	长信科技	1,814,400	12,138,336.00	0.35
71	603225	新凤鸣	847,900	12,040,180.00	0.35
72	300394	天孚通信	130,700	11,961,664.00	0.35
73	300748	金力永磁	587,557	11,880,402.54	0.34
74	300843	胜蓝股份	507,800	11,669,244.00	0.34
75	688083	中望软件	117,086	11,654,740.44	0.34
76	002393	力生制药	439,100	11,460,510.00	0.33
77	002791	坚朗五金	279,600	11,321,004.00	0.33
78	601999	出版传媒	1,508,400	11,222,496.00	0.32
79	300424	航新科技	853,880	11,185,828.00	0.32
80	000039	中集集团	1,459,200	11,162,880.00	0.32
81	600760	中航沈飞	264,142	11,141,509.56	0.32
82	603893	瑞芯微	173,900	11,025,260.00	0.32
83	600745	闻泰科技	258,900	10,954,059.00	0.32
84	000338	潍柴动力	802,200	10,950,030.00	0.32
85	603258	电魂网络	470,200	10,805,196.00	0.31
86	300980	祥源新材	459,300	10,775,178.00	0.31
87	688088	虹软科技	260,310	10,683,122.40	0.31
88	002624	完美世界	886,800	10,499,712.00	0.30
89	688777	中控技术	229,226	10,395,399.10	0.30



90	688626	翔宇医疗	193,644	10,319,288.76	0.30
91	605169	洪通燃气	909,816	10,308,215.28	0.30
92	300227	光韵达	1,308,504	10,258,671.36	0.30
93	300681	英搏尔	530,100	10,215,027.00	0.29
94	300213	佳讯飞鸿	1,416,000	10,195,200.00	0.29
95	002835	同为股份	562,900	10,098,426.00	0.29
96	601137	博威合金	640,982	9,954,450.46	0.29
97	002641	公元股份	1,978,300	9,950,849.00	0.29
98	600460	士兰微	433,900	9,905,937.00	0.29
99	603261	立航科技	289,300	9,868,023.00	0.28
100	603055	台华新材	819,300	9,864,372.00	0.28
101	000977	浪潮信息	295,500	9,810,600.00	0.28
102	000938	紫光股份	506,700	9,804,645.00	0.28
103	603297	永新光学	98,379	9,773,953.65	0.28
104	300440	运达科技	1,280,300	9,538,235.00	0.28
105	300310	宜通世纪	2,123,000	9,383,660.00	0.27
106	300496	中科创达	116,000	9,286,960.00	0.27
107	300605	恒锋信息	615,000	9,206,550.00	0.27
108	603508	思维列控	582,327	9,142,533.90	0.26
109	300395	菲利华	249,796	9,132,541.76	0.26
110	301107	瑜欣电子	283,000	9,081,470.00	0.26
111	603986	兆易创新	96,240	8,891,613.60	0.26
112	300303	聚飞光电	1,499,100	8,889,663.00	0.26
113	688511	天微电子	282,066	8,876,617.02	0.26
114	300389	艾比森	510,200	8,846,868.00	0.26
115	605116	奥锐特	339,300	8,760,726.00	0.25
116	603444	吉比特	35,700	8,750,784.00	0.25
117	300976	达瑞电子	162,460	8,647,745.80	0.25
118	688169	石头科技	30,391	8,599,133.45	0.25
119	300679	电连技术	205,921	8,545,721.50	0.25
120	688033	天宜上佳	504,800	8,531,120.00	0.25

121	603093	南华期货	697,800	8,373,600.00	0.24
122	002938	鹏鼎控股	373,600	8,338,752.00	0.24
123	688300	联瑞新材	156,400	8,281,380.00	0.24
124	002027	分众传媒	1,306,700	8,258,344.00	0.24
125	000403	派林生物	302,400	8,237,376.00	0.24
126	688789	宏华数科	82,400	8,232,584.00	0.24
127	003004	声迅股份	269,900	8,223,853.00	0.24
128	000823	超声电子	856,500	8,196,705.00	0.24
129	300791	仙乐健康	236,400	8,193,624.00	0.24
130	300951	博硕科技	126,000	8,162,280.00	0.24
131	000725	京东方 A	2,090,500	8,152,950.00	0.24
132	688246	嘉和美康	243,824	8,148,598.08	0.24
133	301349	信德新材	172,558	8,124,030.64	0.23
134	603992	松霖科技	447,300	8,114,022.00	0.23
135	301155	海力风电	136,500	8,073,975.00	0.23
136	301391	卡莱特	70,300	8,047,944.00	0.23
137	688489	三未信安	170,810	8,031,486.20	0.23
138	600602	云赛智联	692,000	8,006,440.00	0.23
139	000589	贵州轮胎	1,297,000	7,937,640.00	0.23
140	688147	微导纳米	203,000	7,914,970.00	0.23
141	603590	康辰药业	207,800	7,913,024.00	0.23
142	688210	统联精密	302,192	7,902,320.80	0.23
143	002971	和远气体	284,900	7,897,428.00	0.23
144	605167	利柏特	820,700	7,788,443.00	0.22
145	300638	广和通	409,140	7,785,934.20	0.22
146	002332	仙琚制药	607,900	7,762,883.00	0.22
147	688578	艾力斯	186,225	7,758,133.50	0.22
148	002215	诺普信	939,000	7,756,140.00	0.22
149	301045	天禄科技	284,300	7,732,960.00	0.22
150	002384	东山精密	425,300	7,731,954.00	0.22
151	300462	华铭智能	655,300	7,725,987.00	0.22

152	603817	海峡环保	1,210,700	7,724,266.00	0.22
153	600986	浙文互联	1,406,600	7,680,036.00	0.22
154	301193	家联科技	451,840	7,672,243.20	0.22
155	300851	交大思诺	245,900	7,664,703.00	0.22
156	605060	联德股份	409,600	7,659,520.00	0.22
157	300319	麦捷科技	793,900	7,653,196.00	0.22
158	605128	上海沿浦	131,300	7,621,965.00	0.22
159	688078	龙软科技	187,969	7,578,910.08	0.22
160	688630	芯碁微装	88,600	7,563,782.00	0.22
161	603505	金石资源	276,360	7,503,174.00	0.22
162	688568	中科星图	152,903	7,501,421.18	0.22
163	688656	浩欧博	215,206	7,480,560.56	0.22
164	002430	杭氧股份	254,700	7,439,787.00	0.21
165	600288	大恒科技	650,700	7,404,966.00	0.21
166	300218	安利股份	545,900	7,396,945.00	0.21
167	600312	平高电气	582,800	7,395,732.00	0.21
168	603558	健盛集团	752,700	7,293,663.00	0.21
169	000902	新洋丰	639,800	7,287,322.00	0.21
170	603699	纽威股份	524,900	7,275,114.00	0.21
171	600989	宝丰能源	490,000	7,237,300.00	0.21
172	002444	巨星科技	320,200	7,210,904.00	0.21
173	300870	欧陆通	162,800	7,207,156.00	0.21
174	688655	迅捷兴	476,475	7,194,772.50	0.21
175	300824	北鼎股份	794,281	7,172,357.43	0.21
176	603393	新天然气	232,415	7,104,926.55	0.21
177	300560	中富通	389,900	6,905,129.00	0.20
178	002138	顺络电子	254,698	6,879,392.98	0.20
179	600623	华谊集团	1,060,100	6,827,044.00	0.20
180	300563	神宇股份	421,400	6,738,186.00	0.19
181	002927	泰永长征	427,300	6,725,702.00	0.19
182	301257	普蕊斯	104,100	6,610,350.00	0.19

183	605158	华达新材	867,230	6,590,948.00	0.19
184	600237	铜峰电子	851,500	6,590,610.00	0.19
185	002352	顺丰控股	162,400	6,560,960.00	0.19
186	688696	极米科技	57,800	6,530,244.00	0.19
187	600455	博通股份	260,600	6,475,910.00	0.19
188	688046	药康生物	317,333	6,394,259.95	0.18
189	300468	四方精创	584,800	6,345,080.00	0.18
190	002745	木林森	731,600	6,335,656.00	0.18
191	600386	北巴传媒	1,398,500	6,265,280.00	0.18
192	002171	楚江新材	837,100	6,261,508.00	0.18
193	601138	工业富联	413,800	6,256,656.00	0.18
194	002646	天佑德酒	456,300	6,210,243.00	0.18
195	300491	通合科技	277,900	6,191,612.00	0.18
196	301302	华如科技	245,100	6,154,461.00	0.18
197	688517	金冠电气	380,600	6,009,674.00	0.17
198	603602	纵横通信	404,600	5,963,804.00	0.17
199	002133	广宇集团	1,687,000	5,887,630.00	0.17
200	603678	火炬电子	218,000	5,770,460.00	0.17
201	600754	锦江酒店	187,700	5,612,230.00	0.16
202	300936	中英科技	131,200	5,593,056.00	0.16
203	002255	海陆重工	1,056,000	5,586,240.00	0.16
204	601633	长城汽车	221,300	5,581,186.00	0.16
205	002831	裕同科技	200,900	5,526,759.00	0.16
206	600737	中粮糖业	669,900	5,519,976.00	0.16
207	300987	川网传媒	308,500	5,466,620.00	0.16
208	300768	迪普科技	367,950	5,438,301.00	0.16
209	600184	光电股份	475,100	5,430,393.00	0.16
210	300857	协创数据	102,300	5,420,877.00	0.16
211	603530	神马电力	261,300	5,419,362.00	0.16
212	000528	柳工	797,400	5,374,476.00	0.16
213	600183	生益科技	293,200	5,368,492.00	0.15

214	300378	鼎捷软件	250,200	5,331,762.00	0.15
215	002558	巨人网络	476,300	5,305,982.00	0.15
216	300377	赢时胜	678,300	5,263,608.00	0.15
217	603167	渤海轮渡	589,600	5,235,648.00	0.15
218	002334	英威腾	596,800	5,210,064.00	0.15
219	300514	友讯达	319,300	5,204,590.00	0.15
220	601186	中国铁建	681,400	5,185,454.00	0.15
221	600363	联创光电	150,600	5,120,400.00	0.15
222	600595	中孚实业	1,468,400	5,110,032.00	0.15
223	300884	狄耐克	385,700	5,044,956.00	0.15
224	300283	温州宏丰	787,500	5,008,500.00	0.14
225	600150	中国船舶	169,600	4,993,024.00	0.14
226	603218	日月股份	402,100	4,973,977.00	0.14
227	002724	海洋王	601,300	4,942,686.00	0.14
228	002139	拓邦股份	505,200	4,930,752.00	0.14
229	300613	富瀚微	115,000	4,880,600.00	0.14
230	002519	银河电子	782,900	4,830,493.00	0.14
231	301008	宏昌科技	159,700	4,821,343.00	0.14
232	688018	乐鑫科技	46,600	4,797,470.00	0.14
233	601898	中煤能源	493,200	4,779,108.00	0.14
234	688550	瑞联新材	117,000	4,642,560.00	0.13
235	600556	天下秀	783,700	4,631,667.00	0.13
236	600900	长江电力	198,200	4,625,988.00	0.13
237	002402	和而泰	323,700	4,625,673.00	0.13
238	688036	传音控股	33,399	4,622,421.60	0.13
239	002609	捷顺科技	403,500	4,607,970.00	0.13
240	002230	科大讯飞	99,100	4,596,258.00	0.13
241	000733	振华科技	77,300	4,548,332.00	0.13
242	300739	明阳电路	297,000	4,547,070.00	0.13
243	688325	赛微微电	114,600	4,491,174.00	0.13
244	002969	嘉美包装	1,082,800	4,461,136.00	0.13

245	688135	利扬芯片	195,517	4,361,984.27	0.13
246	002209	达意隆	394,800	4,342,800.00	0.13
247	603050	科林电气	241,630	4,337,258.50	0.13
248	301235	华康医疗	169,200	4,336,596.00	0.13
249	002106	莱宝高科	405,500	4,314,520.00	0.12
250	688772	珠海冠宇	193,450	4,257,834.50	0.12
251	603920	世运电路	232,900	4,257,412.00	0.12
252	600580	卧龙电驱	360,500	4,228,665.00	0.12
253	603096	新经典	211,700	4,166,256.00	0.12
254	000636	风华高科	304,600	4,160,836.00	0.12
255	002179	中航光电	106,256	4,143,984.00	0.12
256	688244	永信至诚	74,200	4,139,618.00	0.12
257	002152	广电运通	332,100	4,071,546.00	0.12
258	688209	英集芯	227,200	4,057,792.00	0.12
259	300932	三友联众	247,000	4,021,160.00	0.12
260	600879	航天电子	520,500	4,013,055.00	0.12
261	688439	振华风光	44,800	3,992,128.00	0.12
262	688329	艾隆科技	159,200	3,957,712.00	0.11
263	300211	亿通科技	389,500	3,937,845.00	0.11
264	688312	燕麦科技	190,400	3,931,760.00	0.11
265	603686	福龙马	382,700	3,915,021.00	0.11
266	603516	淳中科技	174,100	3,912,027.00	0.11
267	603579	荣泰健康	187,500	3,905,625.00	0.11
268	301080	百普赛斯	65,950	3,887,093.00	0.11
269	600979	广安爱众	1,119,800	3,874,508.00	0.11
270	603421	鼎信通讯	406,800	3,823,920.00	0.11
271	300438	鹏辉能源	134,500	3,805,005.00	0.11
272	300558	贝达药业	73,800	3,804,390.00	0.11
273	301162	国能日新	72,868	3,780,391.84	0.11
274	603617	君禾股份	410,900	3,780,280.00	0.11
275	688007	光峰科技	145,600	3,768,128.00	0.11

276	002827	高争民爆	220,200	3,688,350.00	0.11
277	000404	长虹华意	624,800	3,680,072.00	0.11
278	301222	浙江恒威	122,900	3,653,817.00	0.11
279	600019	宝钢股份	613,800	3,639,834.00	0.11
280	600438	通威股份	142,800	3,574,284.00	0.10
281	688201	信安世纪	181,395	3,569,853.60	0.10
282	601368	绿城水务	660,400	3,533,140.00	0.10
283	688171	纬德信息	156,681	3,525,322.50	0.10
284	600258	首旅酒店	224,300	3,503,566.00	0.10
285	603283	赛腾股份	47,900	3,475,624.00	0.10
286	002557	洽洽食品	99,600	3,468,072.00	0.10
287	000737	北方铜业	597,900	3,467,820.00	0.10
288	601398	工商银行	725,300	3,466,934.00	0.10
289	301227	森鹰窗业	126,300	3,418,941.00	0.10
290	000157	中联重科	505,000	3,297,650.00	0.10
291	601098	中南传媒	323,800	3,293,046.00	0.10
292	688393	安必平	131,800	3,291,046.00	0.10
293	603517	绝味食品	122,100	3,279,606.00	0.09
294	002381	双箭股份	424,700	3,219,226.00	0.09
295	688227	品高股份	168,776	3,218,558.32	0.09
296	300207	欣旺达	212,800	3,140,928.00	0.09
297	605118	力鼎光电	129,300	3,127,767.00	0.09
298	603937	丽岛新材	246,500	3,123,155.00	0.09
299	688571	杭华股份	416,800	3,117,664.00	0.09
300	002479	富春环保	644,300	3,073,311.00	0.09
301	688580	伟思医疗	46,981	3,003,495.33	0.09
302	603076	乐惠国际	111,700	2,993,560.00	0.09
303	002878	元隆雅图	160,700	2,990,627.00	0.09
304	301093	华兰股份	91,300	2,948,990.00	0.09
305	000932	华菱钢铁	570,300	2,937,045.00	0.08
306	603999	读者传媒	420,700	2,890,209.00	0.08

307	001696	宗申动力	431,100	2,858,193.00	0.08
308	301196	唯科科技	83,000	2,853,540.00	0.08
309	600563	法拉电子	30,800	2,852,080.00	0.08
310	002129	TCL中环	181,950	2,845,698.00	0.08
311	688683	莱尔科技	109,585	2,803,184.30	0.08
312	002436	兴森科技	187,400	2,760,402.00	0.08
313	002462	嘉事堂	194,000	2,756,740.00	0.08
314	002664	信质集团	164,900	2,742,287.00	0.08
315	000533	顺钠股份	577,900	2,710,351.00	0.08
316	301086	鸿富瀚	57,900	2,676,138.00	0.08
317	600276	恒瑞医药	58,700	2,655,001.00	0.08
318	688026	洁特生物	153,000	2,637,720.00	0.08
319	002967	广电计量	174,300	2,616,243.00	0.08
320	000429	粤高速 A	307,300	2,599,758.00	0.08
321	601607	上海医药	153,500	2,568,055.00	0.07
322	002925	盈趣科技	130,400	2,538,888.00	0.07
323	000948	南天信息	168,400	2,537,788.00	0.07
324	300413	芒果超媒	99,800	2,514,960.00	0.07
325	300484	蓝海华腾	197,300	2,491,899.00	0.07
326	000997	新大陆	126,200	2,474,782.00	0.07
327	603103	横店影视	138,100	2,455,418.00	0.07
328	603833	欧派家居	35,163	2,447,696.43	0.07
329	688686	奥普特	21,800	2,441,600.00	0.07
330	601688	华泰证券	174,700	2,437,065.00	0.07
331	688597	煜邦电力	263,200	2,395,120.00	0.07
332	600325	华发股份	329,200	2,373,532.00	0.07
333	688733	壹石通	81,000	2,370,870.00	0.07
334	002367	康力电梯	315,000	2,368,800.00	0.07
335	002245	蔚蓝锂芯	275,100	2,343,852.00	0.07
336	688067	爱威科技	98,169	2,337,403.89	0.07
337	002850	科达利	27,600	2,331,096.00	0.07



338	601311	骆驼股份	289,700	2,320,497.00	0.07
339	688601	力芯微	44,259	2,318,729.01	0.07
340	600839	四川长虹	434,100	2,296,389.00	0.07
341	002483	润邦股份	437,600	2,284,272.00	0.07
342	002284	亚太股份	260,300	2,282,831.00	0.07
343	688080	映翰通	55,400	2,248,132.00	0.06
344	603386	骏亚科技	162,600	2,243,880.00	0.06
345	002687	乔治白	420,015	2,238,679.95	0.06
346	301087	可孚医疗	58,500	2,217,150.00	0.06
347	002134	天津普林	202,100	2,217,037.00	0.06
348	603090	宏盛股份	93,700	2,203,824.00	0.06
349	601567	三星医疗	107,300	2,199,650.00	0.06
350	300019	硅宝科技	132,300	2,184,273.00	0.06
351	002922	伊戈尔	146,800	2,179,980.00	0.06
352	600741	华域汽车	133,600	2,175,008.00	0.06
353	300223	北京君正	33,600	2,172,240.00	0.06
354	300787	海能实业	128,600	2,163,052.00	0.06
355	002912	中新赛克	77,200	2,160,828.00	0.06
356	002180	纳思达	95,400	2,158,902.00	0.06
357	601800	中国交建	282,400	2,146,240.00	0.06
358	688616	西力科技	157,347	2,146,213.08	0.06
359	002128	电投能源	149,400	2,131,938.00	0.06
360	002271	东方雨虹	109,800	2,108,160.00	0.06
361	601668	中国建筑	433,900	2,087,059.00	0.06
362	600774	汉商集团	209,500	2,065,670.00	0.06
363	605123	派克新材	22,600	2,061,120.00	0.06
364	300240	飞力达	305,700	2,060,418.00	0.06
365	603185	弘元绿能	61,900	2,060,032.00	0.06
366	603806	福斯特	83,763	2,032,928.01	0.06
367	603700	宁水集团	142,200	2,029,194.00	0.06
368	300519	新光药业	122,300	2,026,511.00	0.06

369	002401	中远海科	111,800	2,025,816.00	0.06
370	603897	长城科技	98,800	2,023,424.00	0.06
371	600765	中航重机	105,680	2,019,544.80	0.06
372	002983	芯瑞达	64,600	1,993,556.00	0.06
373	300154	瑞凌股份	269,100	1,991,340.00	0.06
374	603876	鼎胜新材	158,300	1,983,499.00	0.06
375	002774	快意电梯	235,200	1,952,160.00	0.06
376	002533	金杯电工	240,500	1,943,240.00	0.06
377	600223	福瑞达	201,300	1,938,519.00	0.06
378	600570	恒生电子	67,400	1,938,424.00	0.06
379	603298	杭叉集团	77,900	1,938,152.00	0.06
380	300439	美康生物	166,600	1,934,226.00	0.06
381	600548	深高速	212,600	1,911,274.00	0.06
382	600216	浙江医药	177,700	1,906,721.00	0.06
383	603379	三美股份	55,900	1,900,600.00	0.05
384	688181	八亿时空	69,950	1,888,650.00	0.05
385	000576	甘化科工	201,400	1,873,020.00	0.05
386	600025	华能水电	214,600	1,851,998.00	0.05
387	603080	新疆火炬	111,000	1,849,260.00	0.05
388	688607	康众医疗	90,446	1,843,289.48	0.05
389	003030	祖名股份	84,100	1,816,560.00	0.05
390	688155	先惠技术	32,400	1,802,412.00	0.05
391	603328	依顿电子	220,800	1,799,520.00	0.05
392	002137	实益达	258,500	1,793,990.00	0.05
393	688608	恒玄科技	11,603	1,789,994.81	0.05
394	605488	福莱新材	107,700	1,787,820.00	0.05
395	688981	中芯国际	33,697	1,786,614.94	0.05
396	300990	同飞股份	40,000	1,780,400.00	0.05
397	603610	麒盛科技	146,400	1,745,088.00	0.05
398	300674	宇信科技	107,000	1,741,960.00	0.05
399	002566	益盛药业	193,700	1,725,867.00	0.05

400	601126	四方股份	121,600	1,721,856.00	0.05
401	301185	鸥玛软件	84,400	1,718,384.00	0.05
402	000803	山高环能	295,760	1,718,365.60	0.05
403	601000	唐山港	490,800	1,717,800.00	0.05
404	688217	睿昂基因	48,000	1,717,440.00	0.05
405	002517	恺英网络	153,500	1,714,595.00	0.05
406	603031	安孚科技	35,620	1,714,390.60	0.05
407	688060	云涌科技	36,040	1,689,915.60	0.05
408	688261	东微半导	20,200	1,688,518.00	0.05
409	603683	晶华新材	149,700	1,685,622.00	0.05
410	600618	氯碱化工	183,700	1,671,670.00	0.05
411	603556	海兴电力	57,200	1,660,516.00	0.05
412	002111	威海广泰	181,800	1,647,108.00	0.05
413	002416	爱施德	176,900	1,643,401.00	0.05
414	300959	线上线下	45,200	1,627,200.00	0.05
415	300660	江苏雷利	53,700	1,624,962.00	0.05
416	002414	高德红外	222,500	1,624,250.00	0.05
417	600990	四创电子	81,200	1,621,564.00	0.05
418	002706	良信股份	180,300	1,592,049.00	0.05
419	601838	成都银行	140,300	1,579,778.00	0.05
420	600088	中视传媒	122,600	1,574,184.00	0.05
421	603588	高能环境	239,400	1,565,676.00	0.05
422	002991	甘源食品	21,700	1,550,682.00	0.04
423	603501	韦尔股份	14,500	1,547,295.00	0.04
424	688786	悦安新材	34,200	1,519,848.00	0.04
425	300772	运达股份	142,500	1,516,200.00	0.04
426	603115	海星股份	103,400	1,513,776.00	0.04
427	600612	老凤祥	21,900	1,511,100.00	0.04
428	000973	佛塑科技	308,900	1,510,521.00	0.04
429	605580	恒盛能源	128,500	1,493,170.00	0.04
430	300905	宝丽迪	76,600	1,484,508.00	0.04

431	601609	金田股份	217,700	1,473,829.00	0.04
432	688138	清溢光电	64,000	1,447,680.00	0.04
433	688600	皖仪科技	71,661	1,447,552.20	0.04
434	600882	妙可蓝多	90,000	1,446,300.00	0.04
435	688669	聚石化学	77,000	1,442,980.00	0.04
436	603936	博敏电子	136,836	1,428,567.84	0.04
437	688611	杭州柯林	43,400	1,422,652.00	0.04
438	000519	中兵红箭	100,400	1,409,616.00	0.04
439	600141	兴发集团	77,000	1,405,250.00	0.04
440	601865	福莱特	52,300	1,396,410.00	0.04
441	688682	霍莱沃	29,200	1,393,132.00	0.04
442	601989	中国重工	333,500	1,377,355.00	0.04
443	002112	三变科技	131,300	1,376,024.00	0.04
444	000650	仁和药业	205,600	1,363,128.00	0.04
445	603230	内蒙新华	87,500	1,356,250.00	0.04
446	002681	奋达科技	273,700	1,354,815.00	0.04
447	300933	中辰股份	141,800	1,340,010.00	0.04
448	600182	S佳通	90,200	1,336,764.00	0.04
449	002371	北方华创	5,400	1,326,834.00	0.04
450	600202	哈空调	211,900	1,322,256.00	0.04
451	003019	宸展光电	58,353	1,318,777.80	0.04
452	601888	中国中免	15,700	1,313,933.00	0.04
453	603365	水星家纺	90,700	1,304,266.00	0.04
454	600967	内蒙一机	157,400	1,300,124.00	0.04
455	603533	掌阅科技	65,200	1,296,176.00	0.04
456	688188	柏楚电子	5,111	1,293,645.21	0.04
457	001230	劲旅环境	54,400	1,276,224.00	0.04
458	605305	中际联合	39,100	1,263,321.00	0.04
459	002978	安宁股份	39,800	1,260,068.00	0.04
460	300906	日月明	49,800	1,259,442.00	0.04
461	688310	迈得医疗	41,400	1,237,860.00	0.04

462	002635	安洁科技	75,400	1,231,282.00	0.04
463	300822	贝仕达克	81,100	1,222,988.00	0.04
464	600875	东方电气	83,600	1,222,232.00	0.04
465	600153	建发股份	126,500	1,218,195.00	0.04
466	688066	航天宏图	28,800	1,216,512.00	0.04
467	600941	中国移动	12,200	1,213,656.00	0.04
468	300896	爱美客	4,100	1,206,753.00	0.03
469	688663	新风光	42,600	1,194,504.00	0.03
470	002803	吉宏股份	57,900	1,190,424.00	0.03
471	000513	丽珠集团	34,000	1,190,340.00	0.03
472	300373	扬杰科技	32,200	1,181,740.00	0.03
473	600893	航发动力	31,600	1,181,208.00	0.03
474	603551	奥普家居	110,000	1,164,900.00	0.03
475	601700	风范股份	232,400	1,164,324.00	0.03
476	002588	史丹利	181,900	1,160,522.00	0.03
477	002541	鸿路钢构	53,300	1,158,209.00	0.03
478	601088	中国神华	36,600	1,147,410.00	0.03
479	300642	透景生命	64,000	1,129,600.00	0.03
480	603228	景旺电子	50,000	1,128,000.00	0.03
481	601158	重庆水务	198,900	1,127,763.00	0.03
482	688248	南网科技	45,000	1,123,650.00	0.03
483	600801	华新水泥	89,400	1,111,242.00	0.03
484	002130	沃尔核材	146,900	1,109,095.00	0.03
485	688668	鼎通科技	19,600	1,084,272.00	0.03
486	000049	德赛电池	39,200	1,063,104.00	0.03
487	300246	宝莱特	103,050	1,061,415.00	0.03
488	600938	中国海油	50,600	1,061,082.00	0.03
489	600584	长电科技	35,362	1,055,909.32	0.03
490	000555	神州信息	92,700	1,046,583.00	0.03
491	000630	铜陵有色	318,700	1,045,336.00	0.03
492	600535	天士力	60,900	1,036,518.00	0.03

493	603489	八方股份	18,800	1,033,060.00	0.03
494	002459	晶澳科技	49,700	1,029,784.00	0.03
495	000631	顺发恒业	308,400	1,023,888.00	0.03
496	600888	新疆众和	140,700	1,018,668.00	0.03
497	688336	三生国健	44,800	1,008,448.00	0.03
498	688075	安旭生物	25,000	1,007,000.00	0.03
499	603416	信捷电气	26,800	1,006,608.00	0.03
500	600382	广东明珠	219,900	993,948.00	0.03
501	603713	密尔克卫	18,600	989,706.00	0.03
502	688100	威胜信息	34,200	989,064.00	0.03
503	002987	京北方	52,700	979,166.00	0.03
504	300952	恒辉安防	44,500	969,210.00	0.03
505	600391	航发科技	49,900	954,088.00	0.03
506	300973	立高食品	19,600	951,580.00	0.03
507	001316	润贝航科	27,320	951,009.20	0.03
508	603192	汇得科技	48,200	947,130.00	0.03
509	300337	银邦股份	117,000	946,530.00	0.03
510	603181	皇马科技	86,000	939,980.00	0.03
511	300730	科创信息	68,900	937,040.00	0.03
512	002142	宁波银行	46,300	931,093.00	0.03
513	603948	建业股份	40,800	927,792.00	0.03
514	300292	吴通控股	249,200	927,024.00	0.03
515	600285	羚锐制药	54,100	925,651.00	0.03
516	300747	锐科激光	39,300	924,729.00	0.03
517	002615	哈尔斯	126,000	923,580.00	0.03
518	001202	炬申股份	52,500	922,425.00	0.03
519	688093	世华科技	50,600	921,426.00	0.03
520	688096	京源环保	98,200	920,134.00	0.03
521	600507	方大特钢	198,800	916,468.00	0.03
522	301248	杰创智能	51,900	913,959.00	0.03
523	601618	中国中冶	297,400	910,044.00	0.03

524	688330	宏力达	32,000	909,120.00	0.03
525	601988	中国银行	227,700	908,523.00	0.03
526	002866	传艺科技	42,700	906,094.00	0.03
527	601677	明泰铝业	79,600	902,664.00	0.03
528	300696	爱乐达	51,600	898,356.00	0.03
529	688008	澜起科技	15,200	893,152.00	0.03
530	601966	玲珑轮胎	46,300	890,349.00	0.03
531	603198	迎驾贡酒	13,400	888,286.00	0.03
532	605298	必得科技	55,900	871,481.00	0.03
533	300880	迦南智能	43,600	868,512.00	0.03
534	603898	好莱客	78,900	865,533.00	0.02
535	600519	贵州茅台	500	863,000.00	0.02
536	688388	嘉元科技	42,200	855,816.00	0.02
537	605338	巴比食品	39,800	854,904.00	0.02
538	688508	芯朋微	17,208	846,805.68	0.02
539	600551	时代出版	77,300	841,797.00	0.02
540	600600	青岛啤酒	11,200	837,200.00	0.02
541	603320	迪贝电气	52,300	832,093.00	0.02
542	603799	华友钴业	25,200	829,836.00	0.02
543	603810	丰山集团	61,800	826,266.00	0.02
544	688056	莱伯泰科	24,600	824,346.00	0.02
545	002035	华帝股份	132,500	822,825.00	0.02
546	000928	中钢国际	140,400	818,532.00	0.02
547	002015	协鑫能科	66,000	817,080.00	0.02
548	002032	苏泊尔	15,400	816,354.00	0.02
549	300407	凯发电气	86,000	811,840.00	0.02
550	600406	国电南瑞	36,000	803,520.00	0.02
551	301075	多瑞医药	29,900	797,433.00	0.02
552	002900	哈三联	58,300	795,795.00	0.02
553	301077	星华新材	37,700	766,441.00	0.02
554	300645	正元智慧	41,300	751,247.00	0.02

555	601328	交通银行	129,200	741,608.00	0.02
556	300327	中颖电子	32,500	741,000.00	0.02
557	002623	亚玛顿	27,700	740,975.00	0.02
558	600885	宏发股份	26,300	726,932.00	0.02
559	300554	三超新材	26,700	714,225.00	0.02
560	002282	博深股份	88,100	713,610.00	0.02
561	605100	华丰股份	44,596	709,522.36	0.02
562	002254	泰和新材	47,300	707,608.00	0.02
563	603967	中创物流	67,100	693,814.00	0.02
564	688800	瑞可达	17,200	691,096.00	0.02
565	002820	桂发祥	60,000	685,200.00	0.02
566	000708	中信特钢	48,700	683,748.00	0.02
567	000607	华媒控股	148,900	681,962.00	0.02
568	300621	维业股份	59,300	681,357.00	0.02
569	002136	安纳达	58,200	676,284.00	0.02
570	002039	黔源电力	48,700	671,573.00	0.02
571	605180	华生科技	47,800	669,200.00	0.02
572	300994	久祺股份	45,100	662,970.00	0.02
573	603721	中广天择	23,500	658,940.00	0.02
574	601799	星宇股份	5,000	655,550.00	0.02
575	300408	三环集团	22,100	650,845.00	0.02
576	603337	杰克股份	30,000	648,000.00	0.02
577	605398	新炬网络	21,800	643,972.00	0.02
578	688579	山大地纬	50,200	637,540.00	0.02
579	300122	智飞生物	10,400	635,544.00	0.02
580	003008	开普检测	22,700	633,557.00	0.02
581	301057	汇隆新材	37,700	633,360.00	0.02
582	601006	大秦铁路	87,100	627,991.00	0.02
583	300172	中电环保	116,700	626,679.00	0.02
584	600016	民生银行	159,600	596,904.00	0.02
585	002206	海利得	117,600	590,352.00	0.02



586	603380	易德龙	21,150	541,651.50	0.02
587	002001	新和成	31,500	534,240.00	0.02
588	301526	国际复材	97,225	527,153.41	0.02
589	605378	野马电池	20,700	524,331.00	0.02
590	688268	华特气体	7,218	486,348.84	0.01
591	002103	广博股份	59,500	476,595.00	0.01
592	605333	沪光股份	22,900	455,710.00	0.01
593	301056	森赫股份	44,300	452,746.00	0.01
594	600300	维维股份	141,400	439,754.00	0.01
595	603290	斯达半导	2,400	434,400.00	0.01
596	603985	恒润股份	17,400	432,390.00	0.01
597	601096	宏盛华源	39,171	213,323.88	0.01
598	301566	达利凯普	5,755	162,891.85	0.00
599	301413	安培龙	1,633	118,542.96	0.00
600	688716	中研股份	2,668	104,555.63	0.00
601	301500	飞南资源	4,550	98,243.60	0.00
602	301459	丰茂股份	2,077	95,083.08	0.00
603	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
604	301578	辰奕智能	1,175	89,662.16	0.00
605	301548	崇德科技	1,351	82,246.99	0.00
606	603004	鼎龙科技	1,948	69,190.05	0.00
607	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
608	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
609	001239	永达股份	1,887	44,228.22	0.00
610	603231	索宝蛋白	1,610	37,546.81	0.00
611	603373	安邦护卫	876	36,981.40	0.00
612	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
613	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
614	301291	明阳电气	1,206	34,202.16	0.00
615	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
616	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00

617	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
618	301558	三态股份	1,758	24,007.20	0.00
619	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
620	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
621	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
622	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
623	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
624	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
625	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
626	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
627	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
628	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
629	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
630	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
631	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
632	301397	溯联股份	362	16,355.16	0.00
633	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
634	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
635	688629	华丰科技	708	15,505.20	0.00
636	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
637	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
638	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
639	301520	万邦医药	260	13,968.40	0.00
640	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
641	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
642	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
643	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
644	688620	安凯微	1,016	12,009.12	0.00
645	688631	莱斯信息	336	11,844.00	0.00
646	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
647	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00

648	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
649	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
650	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
651	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
652	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
653	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
654	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
655	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
656	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
657	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
658	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
659	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
660	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
661	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
662	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
663	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
664	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
665	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
666	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
667	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
668	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
669	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
670	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
671	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
672	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
673	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
674	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
675	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
676	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
677	301170	锡南科技	250	7,607.50	0.00
678	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00

679	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
680	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
681	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
682	301295	美硕科技	215	7,135.85	0.00
683	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
684	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
685	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
686	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
687	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
688	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
689	603276	恒兴新材	234	5,965.92	0.00
690	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
691	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
692	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
693	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
694	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
695	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
696	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
697	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300017	网宿科技	125,135,358.98	7.43
2	301185	鸥玛软件	112,735,192.34	6.69
3	000063	中兴通讯	104,442,905.68	6.20
4	300002	神州泰岳	100,800,412.49	5.98
5	002660	茂硕电源	100,511,551.00	5.96

6	300750	宁德时代	97,194,836.78	5.77
7	002955	鸿合科技	96,564,430.15	5.73
8	688777	中控技术	94,723,811.75	5.62
9	300130	新国都	94,485,804.16	5.61
10	300789	唐源电气	94,011,950.93	5.58
11	002130	沃尔核材	92,138,529.00	5.47
12	300378	鼎捷软件	91,930,686.23	5.46
13	300701	森霸传感	91,479,841.00	5.43
14	605058	澳弘电子	90,636,995.00	5.38
15	300407	凯发电气	88,763,436.00	5.27
16	600551	时代出版	88,158,053.59	5.23
17	000576	甘化科工	85,157,983.00	5.05
18	002236	大华股份	83,903,544.98	4.98
19	605398	新炬网络	83,334,298.60	4.95
20	605168	三人行	82,499,102.84	4.90
21	688655	迅捷兴	81,588,189.28	4.84
22	002139	拓邦股份	79,626,473.17	4.73
23	301042	安联锐视	79,038,012.89	4.69
24	605258	协和电子	75,253,304.05	4.47
25	603688	石英股份	74,136,049.00	4.40
26	600633	浙数文化	73,627,328.26	4.37
27	603829	洛凯股份	72,707,070.04	4.31
28	603386	骏亚科技	72,072,850.48	4.28
29	002106	莱宝高科	71,198,224.86	4.23
30	301222	浙江恒威	70,606,084.04	4.19
31	002922	伊戈尔	70,449,672.12	4.18
32	002937	兴瑞科技	70,167,078.04	4.16
33	688511	天微电子	69,278,326.31	4.11
34	300545	联得装备	69,237,309.11	4.11
35	002056	横店东磁	69,178,613.03	4.11
36	002415	海康威视	67,977,009.48	4.03

37	300743	天地数码	67,348,777.55	4.00
38	002987	京北方	66,596,161.50	3.95
39	300638	广和通	66,285,438.60	3.93
40	300951	博硕科技	66,005,561.66	3.92
41	301041	金百泽	65,957,864.91	3.91
42	600980	北矿科技	65,648,485.71	3.90
43	688210	统联精密	64,790,862.87	3.84
44	688588	凌志软件	64,403,154.54	3.82
45	603869	新智认知	63,973,140.36	3.80
46	300634	彩讯股份	63,587,829.00	3.77
47	300543	朗科智能	63,256,394.28	3.75
48	002449	国星光电	63,140,050.00	3.75
49	603421	鼎信通讯	62,536,930.32	3.71
50	300541	先进数通	62,498,615.00	3.71
51	300308	中际旭创	62,490,541.86	3.71
52	300822	贝仕达克	62,478,556.75	3.71
53	002952	亚世光电	62,425,972.00	3.70
54	002609	捷顺科技	61,860,793.00	3.67
55	300823	建科机械	61,816,963.00	3.67
56	688689	银河微电	61,768,174.27	3.67
57	002600	领益智造	61,656,612.01	3.66
58	300976	达瑞电子	61,580,214.60	3.65
59	605378	野马电池	61,208,803.22	3.63
60	002322	理工能科	61,019,984.79	3.62
61	605218	伟时电子	60,344,814.00	3.58
62	300866	安克创新	60,013,242.38	3.56
63	300389	艾比森	59,909,036.96	3.56
64	300697	电工合金	59,863,977.52	3.55
65	002983	芯瑞达	59,534,883.00	3.53
66	002446	盛路通信	59,474,341.00	3.53
67	002334	英威腾	59,407,744.00	3.53

68	688078	龙软科技	59,140,558.71	3.51
69	300872	天阳科技	59,000,475.54	3.50
70	300843	胜蓝股份	58,189,116.00	3.45
71	603045	福达合金	57,867,954.36	3.43
72	600826	兰生股份	57,762,517.28	3.43
73	000586	汇源通信	57,431,493.00	3.41
74	300900	广联航空	57,404,258.34	3.41
75	301086	鸿富瀚	57,378,427.00	3.40
76	603508	思维列控	56,902,444.66	3.38
77	688168	安博通	55,857,978.75	3.31
78	300232	洲明科技	55,461,749.80	3.29
79	002976	瑞玛精密	55,002,470.00	3.26
80	002315	焦点科技	54,852,891.98	3.26
81	603050	科林电气	54,519,071.36	3.24
82	603861	白云电器	54,462,062.33	3.23
83	300691	联合光电	54,385,550.04	3.23
84	300965	恒宇信通	54,232,003.80	3.22
85	003019	宸展光电	54,017,474.95	3.21
86	603937	丽岛新材	53,627,565.00	3.18
87	002371	北方华创	53,112,123.01	3.15
88	603859	能科科技	52,937,921.70	3.14
89	002540	亚太科技	52,793,741.00	3.13
90	688296	和达科技	52,683,248.69	3.13
91	300063	天龙集团	52,436,258.00	3.11
92	301052	果麦文化	52,397,376.54	3.11
93	688002	睿创微纳	52,264,941.36	3.10
94	605196	华通线缆	51,743,797.24	3.07
95	603878	武进不锈	51,651,748.98	3.07
96	688685	迈信林	51,349,617.21	3.05
97	300889	爱克股份	51,219,285.32	3.04
98	002519	银河电子	50,966,179.00	3.02

99	688551	科威尔	50,837,397.08	3.02
100	600570	恒生电子	50,832,500.22	3.02
101	688395	正弦电气	50,591,587.59	3.00
102	603399	吉翔股份	50,078,167.00	2.97
103	688246	嘉和美康	49,961,326.06	2.96
104	300133	华策影视	49,788,152.20	2.95
105	688066	航天宏图	49,639,406.91	2.95
106	688579	山大地纬	49,619,650.09	2.94
107	601567	三星医疗	49,553,140.85	2.94
108	002138	顺络电子	49,512,212.18	2.94
109	300674	宇信科技	49,218,595.24	2.92
110	688556	高测股份	49,101,410.91	2.91
111	002730	电光科技	49,071,951.78	2.91
112	002649	博彦科技	48,860,736.78	2.90
113	300447	全信股份	48,794,663.68	2.90
114	300219	鸿利智汇	48,620,254.00	2.89
115	603466	风语筑	48,552,378.06	2.88
116	300842	帝科股份	48,532,909.45	2.88
117	688063	派能科技	48,440,745.16	2.87
118	300624	万兴科技	48,357,326.87	2.87
119	601137	博威合金	48,211,530.45	2.86
120	605167	利柏特	47,974,225.00	2.85
121	300615	欣天科技	47,973,356.60	2.85
122	688080	映翰通	47,909,031.93	2.84
123	603933	睿能科技	47,753,134.48	2.83
124	002134	天津普林	47,710,620.75	2.83
125	300283	温州宏丰	47,480,209.00	2.82
126	688088	虹软科技	47,429,768.20	2.81
127	000811	冰轮环境	47,316,153.00	2.81
128	300468	四方精创	46,956,942.26	2.79
129	688227	品高股份	46,866,579.48	2.78



130	300777	中简科技	46,722,941.63	2.77
131	688188	柏楚电子	46,568,632.53	2.76
132	002555	三七互娱	45,972,840.00	2.73
133	600761	安徽合力	45,796,572.50	2.72
134	000777	中核科技	45,783,653.50	2.72
135	301004	嘉益股份	45,690,915.41	2.71
136	300566	激智科技	45,649,866.28	2.71
137	300246	宝莱特	45,577,763.50	2.70
138	000921	海信家电	45,564,965.65	2.70
139	002576	通达动力	45,450,337.00	2.70
140	000751	锌业股份	44,992,134.50	2.67
141	002351	漫步者	44,963,442.00	2.67
142	300852	四会富仕	44,960,519.60	2.67
143	300274	阳光电源	44,959,821.10	2.67
144	600833	第一医药	44,943,837.00	2.67
145	603444	吉比特	44,887,908.40	2.66
146	600971	恒源煤电	44,613,150.31	2.65
147	600850	电科数字	44,580,517.58	2.65
148	601999	出版传媒	44,553,188.00	2.64
149	600757	长江传媒	44,497,357.32	2.64
150	301153	中科江南	44,419,255.20	2.64
151	300494	盛天网络	44,385,633.98	2.63
152	600455	博通股份	44,262,565.57	2.63
153	002273	水晶光电	44,244,841.62	2.63
154	300424	航新科技	44,176,662.46	2.62
155	603261	立航科技	44,097,046.10	2.62
156	603633	徕木股份	44,084,631.81	2.62
157	002990	盛视科技	43,956,232.00	2.61
158	300856	科思股份	43,750,628.32	2.60
159	688258	卓易信息	43,671,850.72	2.59
160	603686	福龙马	43,508,093.00	2.58

161	601888	中国中免	42,770,563.00	2.54
162	605288	凯迪股份	42,616,176.00	2.53
163	300377	赢时胜	42,560,489.69	2.53
164	603328	依顿电子	42,550,898.00	2.53
165	688138	清溢光电	42,521,359.98	2.52
166	002027	分众传媒	42,473,058.00	2.52
167	300996	普联软件	42,176,076.80	2.50
168	300790	宇瞳光学	41,978,671.10	2.49
169	300936	中英科技	41,855,086.26	2.48
170	688118	普元信息	41,787,030.84	2.48
171	003015	日久光电	41,682,727.00	2.47
172	603383	顶点软件	41,662,179.80	2.47
173	300968	格林精密	41,650,988.00	2.47
174	002533	金杯电工	41,558,879.00	2.47
175	002017	东信和平	41,458,979.50	2.46
176	688616	西力科技	41,342,262.92	2.45
177	688100	威胜信息	41,148,487.43	2.44
178	002296	辉煌科技	41,033,491.40	2.44
179	300491	通合科技	41,014,374.00	2.43
180	300690	双一科技	40,940,877.00	2.43
181	603881	数据港	40,936,304.61	2.43
182	688287	观典防务	40,913,835.40	2.43
183	301302	华如科技	40,738,844.71	2.42
184	300394	天孚通信	40,281,246.60	2.39
185	002352	顺丰控股	40,280,688.78	2.39
186	300440	运达科技	39,931,814.00	2.37
187	000917	电广传媒	39,736,325.37	2.36
188	688036	传音控股	39,632,748.85	2.35
189	600312	平高电气	39,551,581.00	2.35
190	600202	哈空调	39,013,664.00	2.32
191	300129	泰胜风能	38,862,573.91	2.31

192	300788	中信出版	38,210,170.00	2.27
193	603056	德邦股份	38,156,303.99	2.26
194	002635	安洁科技	37,868,289.00	2.25
195	688510	航亚科技	37,790,150.35	2.24
196	000555	神州信息	37,342,683.00	2.22
197	002230	科大讯飞	36,908,215.88	2.19
198	603320	迪贝电气	36,549,968.00	2.17
199	002402	和而泰	36,474,874.39	2.16
200	002558	巨人网络	36,289,969.00	2.15
201	002410	广联达	36,061,329.60	2.14
202	301107	瑜欣电子	36,041,159.00	2.14
203	002583	海能达	35,653,955.00	2.12
204	002179	中航光电	35,464,231.36	2.10
205	601958	金钼股份	35,397,849.75	2.10
206	002152	广电运通	35,257,196.00	2.09
207	603199	九华旅游	35,048,927.00	2.08
208	300207	欣旺达	35,022,777.00	2.08
209	688517	金冠电气	34,987,927.83	2.08
210	300939	秋田微	34,792,140.05	2.06
211	603380	易德龙	34,725,915.00	2.06
212	300884	狄耐克	34,636,510.00	2.06
213	000823	超声电子	34,609,823.00	2.05
214	300032	金龙机电	34,484,391.00	2.05
215	300602	飞荣达	34,114,533.91	2.02
216	002947	恒铭达	34,094,420.26	2.02
217	600868	梅雁吉祥	34,072,405.00	2.02
218	003011	海象新材	34,054,876.18	2.02
219	002478	常宝股份	33,998,700.00	2.02
220	000938	紫光股份	33,887,243.00	2.01
221	600105	永鼎股份	33,857,166.70	2.01
222	600583	海油工程	33,856,620.00	2.01

223	000997	新大陆	33,721,346.70	2.00
-----	--------	-----	---------------	------

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300017	网宿科技	133,885,122.07	7.95
2	300002	神州泰岳	129,551,183.52	7.69
3	002660	茂硕电源	121,194,799.67	7.19
4	301185	鸥玛软件	114,932,027.84	6.82
5	300789	唐源电气	100,540,060.63	5.97
6	300130	新国都	100,337,801.90	5.95
7	605398	新炬网络	95,724,932.43	5.68
8	605058	澳弘电子	93,604,758.12	5.55
9	300545	联得装备	93,152,045.63	5.53
10	002955	鸿合科技	92,785,128.22	5.51
11	002130	沃尔核材	91,657,245.28	5.44
12	300407	凯发电气	89,294,926.74	5.30
13	300378	鼎捷软件	89,085,403.44	5.29
14	002139	拓邦股份	88,995,072.00	5.28
15	002937	兴瑞科技	87,906,147.99	5.22
16	600551	时代出版	85,824,582.49	5.09
17	000063	中兴通讯	85,553,628.99	5.08
18	300743	天地数码	85,439,963.98	5.07
19	002236	大华股份	84,811,935.01	5.03
20	605168	三人行	84,591,422.69	5.02
21	688777	中控技术	83,506,797.00	4.96
22	300701	森霸传感	82,814,035.95	4.91

23	603829	洛凯股份	81,690,247.36	4.85
24	000576	甘化科工	81,684,152.00	4.85
25	600633	浙数文化	81,510,330.36	4.84
26	605218	伟时电子	79,199,887.58	4.70
27	002976	瑞玛精密	76,972,109.07	4.57
28	002983	芯瑞达	76,632,418.47	4.55
29	688655	迅捷兴	76,163,581.81	4.52
30	002609	捷顺科技	73,548,125.02	4.36
31	603861	白云电器	72,203,517.99	4.28
32	603869	新智认知	70,612,791.54	4.19
33	603688	石英股份	70,160,931.88	4.16
34	301041	金百泽	69,920,543.61	4.15
35	002106	莱宝高科	69,622,684.03	4.13
36	300900	广联航空	69,283,091.59	4.11
37	600980	北矿科技	67,904,008.97	4.03
38	003019	宸展光电	67,770,799.75	4.02
39	603386	骏亚科技	67,682,952.48	4.02
40	300634	彩讯股份	67,421,746.00	4.00
41	002922	伊戈尔	67,219,356.94	3.99
42	300822	贝仕达克	66,834,723.67	3.97
43	000921	海信家电	66,650,109.88	3.96
44	301222	浙江恒威	66,497,277.64	3.95
45	688078	龙软科技	66,163,121.38	3.93
46	002056	横店东磁	65,956,636.04	3.91
47	002987	京北方	65,452,919.11	3.88
48	300447	全信股份	65,412,485.98	3.88
49	300308	中际旭创	65,350,481.49	3.88
50	002952	亚世光电	64,734,834.36	3.84
51	300615	欣天科技	63,530,231.14	3.77
52	688588	凌志软件	63,440,903.78	3.76
53	605258	协和电子	63,417,038.39	3.76

54	000811	冰轮环境	63,321,940.50	3.76
55	301042	安联锐视	63,178,087.17	3.75
56	300541	先进数通	62,942,605.62	3.74
57	300866	安克创新	62,470,120.15	3.71
58	002322	理工能科	61,712,509.86	3.66
59	688551	科威尔	61,672,107.08	3.66
60	688063	派能科技	61,661,288.75	3.66
61	603933	睿能科技	61,131,742.43	3.63
62	300856	科思股份	60,577,297.93	3.59
63	002600	领益智造	60,382,018.00	3.58
64	688511	天微电子	60,123,344.75	3.57
65	002315	焦点科技	59,981,823.66	3.56
66	605378	野马电池	59,341,583.47	3.52
67	300697	电工合金	59,134,065.08	3.51
68	300638	广和通	59,060,426.16	3.50
69	300691	联合光电	59,034,023.52	3.50
70	300494	盛天网络	59,021,964.00	3.50
71	603328	依顿电子	58,786,463.00	3.49
72	300777	中简科技	58,514,910.03	3.47
73	002446	盛路通信	58,209,276.40	3.45
74	000586	汇源通信	57,710,771.91	3.42
75	600833	第一医药	57,510,237.09	3.41
76	301052	果麦文化	56,197,436.62	3.33
77	600826	兰生股份	55,849,538.63	3.31
78	300951	博硕科技	55,764,209.04	3.31
79	688210	统联精密	55,436,172.36	3.29
80	300389	艾比森	55,323,829.75	3.28
81	603421	鼎信通讯	55,135,803.92	3.27
82	301086	鸿富瀚	55,095,357.54	3.27
83	601567	三星医疗	54,920,184.15	3.26
84	688168	安博通	54,540,255.55	3.24

85	300965	恒宇信通	54,502,141.45	3.23
86	300976	达瑞电子	54,385,093.20	3.23
87	688685	迈信林	54,267,779.82	3.22
88	300939	秋田微	54,169,408.30	3.21
89	300133	华策影视	52,966,679.00	3.14
90	688395	正弦电气	52,513,272.74	3.12
91	300063	天龙集团	52,403,628.00	3.11
92	002334	英威腾	52,261,632.00	3.10
93	688579	山大地纬	52,045,916.59	3.09
94	002371	北方华创	52,043,246.48	3.09
95	300232	洲明科技	51,942,203.60	3.08
96	603937	丽岛新材	51,226,409.00	3.04
97	688002	睿创微纳	51,037,037.85	3.03
98	300842	帝科股份	50,941,662.32	3.02
99	603050	科林电气	50,851,520.76	3.02
100	002576	通达动力	50,673,812.00	3.01
101	605196	华通线缆	50,409,287.44	2.99
102	300624	万兴科技	50,213,790.66	2.98
103	002540	亚太科技	50,211,744.00	2.98
104	603466	风语筑	49,988,510.69	2.97
105	688296	和达科技	49,966,244.47	2.97
106	603878	武进不锈	49,762,455.14	2.95
107	603045	福达合金	49,439,698.98	2.93
108	300882	万胜智能	49,236,969.75	2.92
109	000997	新大陆	49,095,884.37	2.91
110	603859	能科科技	48,880,343.66	2.90
111	301004	嘉益股份	48,775,626.19	2.89
112	300823	建科机械	48,707,598.00	2.89
113	600570	恒生电子	48,389,031.03	2.87
114	300543	朗科智能	48,309,215.55	2.87
115	002134	天津普林	47,702,988.00	2.83

116	688066	航天宏图	47,595,835.92	2.82
117	002519	银河电子	47,239,483.00	2.80
118	603399	吉翔股份	47,108,023.35	2.80
119	600761	安徽合力	46,952,779.42	2.79
120	688188	柏楚电子	46,790,258.60	2.78
121	002351	漫步者	46,475,272.00	2.76
122	300843	胜蓝股份	46,401,906.00	2.75
123	000777	中核科技	46,328,714.00	2.75
124	688258	卓易信息	45,991,509.56	2.73
125	600971	恒源煤电	45,964,210.37	2.73
126	300674	宇信科技	45,920,128.96	2.72
127	002449	国星光电	45,892,693.00	2.72
128	601163	三角轮胎	45,861,120.34	2.72
129	688556	高测股份	45,702,761.88	2.71
130	603508	思维列控	45,153,243.99	2.68
131	301153	中科江南	45,047,949.90	2.67
132	600757	长江传媒	45,041,220.76	2.67
133	300283	温州宏丰	44,954,947.96	2.67
134	300852	四会富仕	44,866,977.40	2.66
135	300246	宝莱特	44,720,021.00	2.65
136	000751	锌业股份	44,700,291.40	2.65
137	688689	银河微电	43,826,389.41	2.60
138	600850	电科数字	43,789,292.82	2.60
139	300872	天阳科技	43,225,148.20	2.57
140	603633	徕木股份	42,972,320.39	2.55
141	688246	嘉和美康	42,965,951.29	2.55
142	688080	映翰通	42,927,921.44	2.55
143	603383	顶点软件	42,715,165.24	2.53
144	688118	普元信息	42,293,938.68	2.51
145	002017	东信和平	42,243,490.16	2.51
146	003015	日久光电	42,163,896.00	2.50



147	002273	水晶光电	42,153,643.98	2.50
148	002138	顺络电子	42,100,311.00	2.50
149	002887	绿茵生态	42,035,222.10	2.49
150	002990	盛视科技	41,658,668.00	2.47
151	688138	清溢光电	41,639,866.68	2.47
152	300788	中信出版	41,632,522.88	2.47
153	300129	泰胜风能	41,330,760.49	2.45
154	300435	中泰股份	41,223,498.00	2.45
155	688227	品高股份	41,024,156.47	2.43
156	603056	德邦股份	40,816,036.67	2.42
157	601888	中国中免	40,794,844.30	2.42
158	603686	福龙马	40,592,443.20	2.41
159	002533	金杯电工	40,569,395.74	2.41
160	002463	沪电股份	40,555,998.62	2.41
161	300690	双一科技	40,290,092.49	2.39
162	688287	观典防务	40,045,082.54	2.38
163	603199	九华旅游	39,996,919.00	2.37
164	300968	格林精密	39,364,897.12	2.34
165	600105	永鼎股份	39,330,480.43	2.33
166	300936	中英科技	39,069,253.63	2.32
167	600455	博通股份	38,887,098.37	2.31
168	000917	电广传媒	38,858,443.75	2.31
169	605167	利柏特	38,773,767.00	2.30
170	603881	数据港	38,585,630.01	2.29
171	688088	虹软科技	38,496,740.16	2.28
172	688100	威胜信息	38,466,442.80	2.28
173	603920	世运电路	38,430,285.92	2.28
174	600202	哈空调	38,367,607.00	2.28
175	002730	电光科技	38,360,912.50	2.28
176	601137	博威合金	38,184,352.45	2.27
177	002635	安洁科技	38,164,552.00	2.26

178	300514	友讯达	38,062,462.00	2.26
179	002947	恒铭达	38,028,627.62	2.26
180	002752	昇兴股份	37,477,580.00	2.22
181	300219	鸿利智汇	37,446,791.09	2.22
182	688636	智明达	37,214,579.92	2.21
183	300032	金龙机电	36,967,576.00	2.19
184	601958	金钼股份	36,723,048.25	2.18
185	300765	新诺威	36,721,005.53	2.18
186	300468	四方精创	36,695,983.96	2.18
187	300889	爱克股份	36,685,925.89	2.18
188	688616	西力科技	36,465,949.71	2.16
189	300491	通合科技	35,933,321.00	2.13
190	300689	澄天伟业	35,915,195.90	2.13
191	603096	新经典	35,569,321.00	2.11
192	603757	大元泵业	35,470,310.05	2.10
193	603320	迪贝电气	35,469,325.10	2.10
194	603380	易德龙	35,330,375.06	2.10
195	688036	传音控股	35,291,638.71	2.09
196	002103	广博股份	35,258,152.00	2.09
197	002402	和而泰	35,198,409.99	2.09
198	601699	潞安环能	35,139,523.44	2.09
199	600868	梅雁吉祥	35,078,117.21	2.08
200	300377	赢时胜	34,889,946.64	2.07
201	002478	常宝股份	34,768,578.00	2.06
202	002583	海能达	34,617,702.00	2.05
203	600583	海油工程	34,494,295.36	2.05
204	002981	朝阳科技	34,479,097.00	2.05
205	603095	越剑智能	34,454,577.97	2.04
206	002829	星网宇达	34,108,737.62	2.02
207	000555	神州信息	33,963,916.00	2.02
208	603331	百达精工	33,898,427.39	2.01

209	601999	出版传媒	33,758,016.00	2.00
-----	--------	------	---------------	------

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	25,457,136,590.09
卖出股票收入（成交）总额	24,058,368,654.91

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	178,687,383.02	5.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	334,513.19	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	179,021,896.21	5.17

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019709	23国债16	1,235,000	124,146,260.27	3.58

2	019678	22国债13	280,000	28,328,942.47	0.82
3	019703	23国债10	187,000	18,965,488.77	0.55
4	019727	23国债24	72,000	7,246,691.51	0.21
5	123236	家联转债	3,345	334,513.19	0.01

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**  
无。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**  
无。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**  
无。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**  
无。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**  
无。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或者在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

(1) 2023年6月28日，三七互娱网络科技集团股份有限公司（证券代码002555）因涉嫌信息披露违法违规，收到证监会决定立案调查的立案告知书。

本基金采用量化选股策略，上述股票是根据选股模型批量选择出来的个股，由于上述事件并未影响到模型的选股指标体系，且本基金认为不会对公司的投资价值构成实质性负面影响，所以本基金遵循量化模型的选股结果，继续投资上述股票。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。**

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,279,993.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,279,993.44

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博道成长智航	32,433	44,062.72	423,016,520.78	29.60%	1,006,069,619.84	70.40%

股票A						
博道成长智航股票C	25,023	98,573.27	1,693,367,293.14	68.65%	773,231,674.61	31.35%
合计	57,000	68,345.35	2,116,383,813.92	54.33%	1,779,301,294.45	45.67%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博道成长智航股票A	3,202,592.34	0.22%
	博道成长智航股票C	709,648.74	0.03%
	合计	3,912,241.08	0.10%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博道成长智航股票A	>100
	博道成长智航股票C	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博道成长智航股票A	50~100
	博道成长智航股票C	-
	合计	50~100

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C
基金合同生效日(2021年10月26日)基金份额总额	1,621,392,996.40	1,171,980,429.74
本报告期期初基金份额总额	1,230,272,405.91	869,914,636.25
本报告期基金总申购份额	568,001,969.87	2,304,518,309.46
减：本报告期基金总赎回份额	369,188,235.16	707,833,977.96
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,429,086,140.62	2,466,598,967.75

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；  
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本期审计费用请见“7.4.7.17其他费用”。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	10,120,077,595.69	20.45%	5,314,176.92	20.81%	-
广发证券	2	19,531,258,867.69	39.47%	9,988,170.24	39.11%	-
海通证券	2	19,833,826,093.78	40.08%	10,233,471.51	40.07%	-

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
方正证券	55,317,887.41	19.67%	4,000.00	0.00%	-	-	-	-
广发证券	114,299,094.88	40.64%	130,004,000.00	99.99%	-	-	-	-
海通证券	111,646,491.02	39.69%	4,000.00	0.00%	-	-	-	-

注：

- 1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：



- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；
- (4) 具有较强的为投资人提供资产配置及服务的能力，包括但不限于：产品筛选及评审流程完整，具有较为完善的资产配置，客户服务及陪伴体系等。

### 3、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-01-20
2	博道成长智航股票型证券投资基金2022年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
3	博道成长智航股票型证券投资基金更新招募说明书（2023年第1号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-04
4	博道成长智航股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-04
5	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-29
6	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-03-31
7	博道成长智航股票型证券投资基金2022年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
8	博道基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证券报、	2023-04-04

	调整“特定投资群体”（养老金客户）适用范围的公告	证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	
9	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-12
10	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-04-21
11	博道成长智航股票型证券投资基金2023年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21
12	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加北京雪球基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-04
13	博道基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-06
14	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-14
15	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
16	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-19
17	博道基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-07-21

18	博道成长智航股票型证券投资基金2023年第二季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-21
19	博道基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-12
20	博道成长智航股票型证券投资基金合同	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-12
21	博道成长智航股票型证券投资基金托管协议	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-12
22	博道成长智航股票型证券投资基金（更新）招募说明书（2023年第2号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-14
23	博道成长智航股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-14
24	博道基金管理有限公司关于增加兴业银行股份有限公司为博道成长智航股票型证券投资基金销售机构的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-15
25	博道基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下权益基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-24
26	博道基金管理有限公司旗下部分基金中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-08-31
27	博道成长智航股票型证券投资基金2023年中期报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-31
28	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-21

29	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-10-25
30	博道成长智航股票型证券投资基金2023年第三季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-25
31	博道成长智航股票型证券投资基金（更新）招募说明书（2023年第3号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-04
32	博道成长智航股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-04
33	博道基金管理有限公司关于旗下基金开展直销转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-24
34	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-27
35	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-28

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道成长智航股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道成长智航股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道成长智航股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道成长智航股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道成长智航股票型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；

8、报告期内博道成长智航股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（[www.bdfund.cn](http://www.bdfund.cn)）查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博道基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-085-2888（免长途话费）。

博道基金管理有限公司  
二〇二四年三月二十九日